X-pand into the Future

eurex rundschreiben 052/16

Datum: 2. Mai 2016
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

⚠ **Aktion erforderlich**

A. Aktien-Futures: Einführung von sechs Aktien-Futures; B. Aktiendividenden-Futures: Einführung von drei Aktiendividenden-Futures

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Alle Abteilungen	Geänderte Annexe A und D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben mit Wirkung zum **23. Mai 2016** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von sechs Aktien-Futures gemäß Annex A aus dem Anhang.
2. Einführung von drei Aktiendividenden-Futures gemäß Annex D aus dem Anhang.

Die Mindestanzahl handelbarer Kontrakte für die Eurex-Trade-Entry-Services beträgt jeweils einen Kontrakt.

eurex

Eurex Deutschland
Börsenplatz 4
60313 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
memberservices@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Dr. Thomas Book, Mehtap
Dinc, Erik Tim Müller,
Michael Peters

ARBN: 101 013 361

A. Aktien-Futures: Einführung von sechs Aktien-Futures; B. Aktiendividenden-Futures: Einführung von drei Aktiendividenden-Futures

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future/ Dividenden-Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Physisch
BIOH	BB Biotech AG	CH0038389992	CH01	CHF	DE000A2BM074	B4OH	B5OH
FSEI	TELEVISION FRANCAISE 1 S.A.	FR0000054900	FR01	EUR	DE000A2BM082	F4EI	F5EI
G4SK	GlaxoSmithKline PLC	XC000A1KD0Y5	GB21	GBX	DE000A2BM090	-----	-----
GSKH	GlaxoSmithKline PLC	GB0009252882	GB01	GBX	DE000A2BM1A4	GS4H	-----
I3SP	ArcelorMittal S.A.	XC000A1DKC93	NL21	EUR	DE000A2BM1B2	-----	-----
ISPH	ArcelorMittal S.A.	LU0323134006	NL01	EUR	DE000A2BM1C0	IS4H	IS5H
LLOH	Lloyds TSB Group PLC	GB0008706128	GB01	GBX	DE000A2BM1D8	LL4H	-----
PRUG	Prudential PLC	GB0007099541	GB01	GBX	DE000A2BM1E6	PR4G	-----
V3AC	Vallourec S.A.	XC000A13RNB1	FR21	EUR	DE000A2BM1F3	-----	-----

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
BIOH	100	0,0001	1	SNSFSC
FSEI	100	0,0001	1	ENSFSE
G4SK	1000	0,01	1	XNCHYG
GSKH	1000	0,0001	1	XNCFSG
I3SP	1000	0,001	1	XNCHYE
ISPH	100	0,0001	1	ENSFSE
LLOH	1000	0,0001	1	XNCFSG
PRUG	1000	0,0001	1	XNCFSG
V3AC	1000	0,001	1	XNCHYE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Aktien-Futures und die neuen Aktiendividenden-Futures identisch mit denen für die bereits bestehenden Aktien-Futures bzw. Aktiendividenden-Futures gemäß der Eurex-Gruppenkennung; dies trifft auch auf die Handelszeiten und den Handelskalender, den letzten Handelstag, die Erfüllung sowie die Ermittlung des täglichen Abrechnungspreises und des Schluss-abrechnungspreises zu.

Die aktualisierten Annexe A und D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich werden zum Produkteinführungsdatum auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

3. Risikoparameter

Die gültigen Risikoparameter werden nach deren Aufsetzen in T7 von Eurex Exchange per „Theoretical Price Files“ übertragen. Mit Handelsstart werden die Parameter auch unter dem folgenden Link auf der Eurex-Website veröffentlicht:

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Derzeit sind alle zum Handel zugelassenen Derivate auf Aktien, Aktienindizes, Fixed Income- und Geldmarktinstrumente sowie alle OTC IRS-Produkte für die Berechnung in Eurex Clearing Prisma zugelassen.

Die Risikoparameter für die neuen Produkte finden Sie auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link:

Risikomanagement > Risikoparameter

Dort finden Sie auch eine aktuelle Liste mit Details zu allen Prisma-fähigen Eurex-Produkten.

4. Mistrade-Parameter und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für die neuen Aktien-Futures und die neuen Aktiendividenden-Futures stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter den folgenden Links zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Produkte > Dividendenderivate > Aktiendividenden-Derivate

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Werte wie für schon bestehende Aktien-Futures und Aktiendividenden-Futures gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Technologie > Entgelt für exzessive Systemnutzung

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen Produkte sind analog zu den entsprechenden bestehenden Aktien-Futures bzw. Aktiendividenden-Futures.

7. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel entnehmen Sie bitte ab Handelsstart der Eurex-Website unter dem Link:

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

2. Mai 2016

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:
ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN
LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

Annex A zu Ziffer 1.6 der Kontraktspezifikationen:

Futures auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Währung **
[…]						
ArcelorMittal S.A.	ISPH	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
BB Biotech AG	BIOH	CH01	XSWX	100	0,0001	CHF
GlaxoSmithKline PLC	GSKH	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
Lloyds TSB Group PLC	LLOH	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
Prudential PLC	PRUG	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
TELEVISION FRANCAISE 1 S.A.	FSEI	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
[…]						

* Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID werden von den Eurex-Börsen entsprechend der nachfolgenden Tabelle vergeben und dienen unter anderem der Festlegung eines Handelsplatzes für den Preis der dem Kontrakt zugrunde liegenden Aktie.

** GBX: Pence Sterling

[…]

Annex D zu Ziffer 1.14 der Kontraktspezifikationen:

Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden ("Aktiendividenden-Futures")	Produkt-kennung	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Wäh-rung**
[…]						
ArcelorMittal S.A.	I3SP	NL21	XAMS	1000	0,001	EUR
GlaxoSmithKline PLC	G4SK	GB21	XLON	1000	0,01	GBX
Vallourec S.A.	V3AC	FR21	XPAR	1000	0,001	EUR
[…]						

* Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID werden von den Eurex-Börsen entsprechend der nachfolgenden Tabelle vergeben und haben lediglich eine interne Zuordnungsfunktion.

** GBX: Pence Sterling

[…]

****