X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 072/11*

Datum: 8. April 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

Hohe Priorität

Single Stock Futures: Einführung von elf SSFs auf Aktienzertifikate russischer Basiswerte

Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10,
Tobias Ehinger (Eurex Product Development), Tel. +44-207-8 62-72 31,
E-Mail: tobias.ehinger@eurexchange.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderte Abschnitte von Annex A der Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Options-kontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben mit Wirkung zum **18. April 2011** die Einführung von elf Single Stock Futures auf Aktienzertifikate (Depositary Receipts) russischer Basiswerte beschlossen.

Zwei Basiswerte der neuen Single Stock Futures werden in den USA gehandelt. Daher werden diese Produkte als US-Single Stock Futures eingeführt und der Eurex-Gruppenkennung US01 zugeordnet. Damit finden für diese Produkte entsprechend die Vorschriften für US-Single Stock Futures Anwendung.

Bitte beachten Sie insbesondere die unterschiedliche Behandlung von Kapitalmaßnahmen und der Feststellung des finalen Abrechnungspreises gegenüber Single Stock Futures der Eurex-Gruppenkennung RU01.

Single Stock Futures: Einführung von elf SSFs auf Aktienzertifikate russischer Basiswerte

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung neuer Single Stock Futures zum 18. April 2011 beschlossen.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Futures auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Länder-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Futures	
						Bar	Phy-sisch
SQYF	AFI Development PLC	US00106J2006	RU01	USD	DE000A1KP5Q8	SQY4	-
RG2F	RusGidro OAO	US4662941057	RU01	USD	DE000A1KP5R6	RG24	-
MAGF	Magnit	US55953Q2021	RU01	USD	DE000A1KP5S4	MAG4	-
MHQF	Magnitogorskiy Metallu. Kombin.	US5591892048	RU01	USD	DE000A1KP5T2	MHQ4	-
NCSF	Novorossiyki Mors.Torgovi Port	US67011U2087	RU01	USD	DE000A1KP5U0	NC4F	-
GO1F	Pharmstandard OJSC	US7171402065	RU01	USD	DE000A1KP5V8	GO14	-
PIQF	Gruppa Kompaniy PIK	US69338N2062	RU01	USD	DE000A1KP5W6	PQ4F	-
M6BF	Uralkali JSC	US91688E2063	RU01	USD	DE000A1KP5X4	M64F	-
XVBF	OAO Polimetall	US7317892021	RU01	USD	DE000A1KP5Y2	XV4F	-
MECF	Mechel OAO	US5838401033	**US01**	USD	DE000A1KP5Z9	MEC4	-
MKYF	Mobil'niye TeleSistemy OAO	US6074091090	**US01**	USD	DE000A1KP518	MKY4	-

Produkt-kürzel	Kon-trakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
SQYF	1000	0.0001	1	XNCFSU
RG2F	1000	0.0001	1	XNCFSU
MAGF	100	0.0001	1	XNCFSU
MHQF	100	0.0001	1	XNCFSU
NCSF	100	0.0001	1	XNCFSU
GO1F	100	0.0001	1	XNCFSU
PIQF	1000	0.0001	1	XNCFSU
M6BF	100	0.0001	1	XNCFSU
XVBF	100	0.0001	1	XNCFSU
MECF	100	0.0001	1	XNCFSU
MKYF	100	0.0001	1	XNCFSU

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Single Stock Futures identisch mit denen für die bereits bestehenden Single Stock Futures gemäß der Eurex-Länderkennung; dies trifft auch auf den letzten Handelstag, die Erfüllung sowie die Ermittlung des täglichen Abrechnungspreises und des Schlussabrechnungspreises, die Handelszeiten und den Handelskalender zu.

Der aktualisierte Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich wird zum Produkteinführungsdatum auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Dokumente > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/documents/regulations/contract_specifications_de.html

3. Risikoparameter

Die gültigen Risikoparameter werden nach deren Aufsetzen im Eurex®-System per „Theoretical Price Files“ übertragen. Mit Handelsstart werden die Parameter auch unter dem folgenden Pfad auf der Eurex-Website veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Clearing > Risk & Margining > Risikoparameter & Initial Margins

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/clearing/risk/parameters_de.html

4. Mistrade-Parameter

Mistrade Ranges für die SSFs stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSFs zur Verfügung:

www.eurexchange.com > Handel > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/EQU/FUT/products_de.html

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/technology/transaction_limits_de.html

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen Single Stock Futures sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs.

7. Vendorenkürzel

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

www.eurexchange.com > Handel > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/vendor_product_code_search_de.html

8. Positionslimite

Die Positionslimite werden auf der Eurex-Website publiziert unter:

www.eurexchange.com > Handel > Produkte > Aktienderivate > Aktienfutures

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf den folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/EQU/FUT/products_de.html

8. April 2011

****

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 **
[…]						
AFI Development plc	SQYF	RU01	XLON	1000	0,0001	USD
[…]						
Magnit OAO	MAGF	RU01	XLON	100	0,0001	USD
Magnitogorskiy Metallu.Kombinat OAO	MHQF	RU01	XLON	100	0,0001	USD
[…]						
Mechel OAO	MECF	US01	XNYS	100	0,0001	USD
[…]						
Mobil'niye Telesistemy OAO	MKYF	US01	XNYS	100	0,0001	USD
[…]						
Novorossiyki Mors. Torgovi Port OAO	NCSF	RU01	XLON	100	0,0001	USD
[…]						
OAO Polimetal	XVBF	RU01	XLON	100	0,0001	USD
[…]						
Pharmstandard OAO	GO1F	RU01	XLON	100	0,0001	USD
[…]						
PIK Group OJSC	PIQF	RU01	XLON	1000	0,0001	USD
[…]						
RusGidro OAO	RG2F	RU01	XLON	1000	0,0001	USD
[…]						
Uralkali JSC	M6BF	RU01	XLON	100	0,0001	USD
[…]						

* 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