X-pand into the Future

eurex rundschreiben 294/11

Datum: 12. Dezember 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Aktion erforderlich

Single Stock Futures und Single Stock Dividend Futures: Einführung von neuen SSFs auf RWE AG, RWE AG Vz. sowie eines SSDF auf RWE AG aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 288/11

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

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderte Annexe A und D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund einer Kapitalmaßnahme die Einführung neuer Single Stock Futures (SSFs) auf RWE AG, RWE AG Vz. sowie die Einführung eines Single Stock Dividend Future (SSDF) auf RWE AG zum **12. Dezember 2011** beschlossen.

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
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Thomas Book, Michael Peters,
Andreas Preuß, Peter Reitz,
Jürg Spillmann

ARBN: 101 013 361

Single Stock Futures und Single Stock Dividend Futures: Einführung von neuen SSFs auf RWE AG, RWE AG Vz. sowie eines SSDF auf RWE AG aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund einer Kapitalmaßnahme die Einführung neuer Single Stock Futures (SSFs) auf RWE AG St, RWE AG Vz. sowie die Einführung eines Single Stock Dividend Future (SSDF) auf RWE AG zum 12. Dezember 2011 beschlossen.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
RWEG	RWE AG	DE0007037129	DE01	EUR	DE000A1MLD19	RW4G	RW5G
RW3G	RWE AG VZ	DE0007037145	DE01	EUR	DE000A1MLD27	R43G	R53G
R3WE	RWE DIVIDENDS	XC000A1CRLP3	DE21	EUR	DE000A1MLD35	----	-----

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
RWEG	100	0,0001	1	ENSFSE
RW3G	100	0,0001	1	ENSFSE
R3WE	1000	0,001	1	XNCHYE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs und den SSDF identisch mit denen für die bereits bestehenden SSFs und SSDFs gemäß der Eurex-Gruppenkennung; dies trifft auch auf den letzten Handelstag, die Erfüllung sowie die Ermittlung des täglichen Abrechnungspreises und des Schlussabrechnungspreises, die Handelszeiten und den Handelskalender 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 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 und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für die neuen SSFs und den SSDF stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem entsprechenden Pfad zur Verfügung:

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

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > Produkte > Dividendenderivate > Aktien-Dividendenderiate

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

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs und SSDFs 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 SSFs und den neuen SSDF sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs und SSDFs.

7. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel entnehmen Sie bitte ab Handelsstart unserer Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > 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

12. Dezember 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 **
[…]						
RWE AG	RWEG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
RWE AG - Vz.	RW3G	DE01	XETR	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 1.15 der Kontraktspezifikationen:

Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden ("Aktiendividenden-Futures")	Produkt-kennung	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Wäh-rung**
[…]						
RWE AG	R3WE	DE21	XETR	1000	0,001	EUR
[…]						

[…]