X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 228/11*

Datum: 22. September 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Aktion erforderlich

Single Stock Futures: Einführung eines neuen SSF auf Abengoa SA

Kontakt: Christian Csomos, Product Development, Tel. +44-20-7862-7235
E-Mail: christian.csomos@eurexchange.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderter Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, gültig ab 26. September 2011

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung eines neuen Single Stock Future auf Abengoa SA zum **26. September 2011** beschlossen.

Single Stock Futures: Einführung eines neuen SSF auf Abengoa SA

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) auf Abengoa SA zum 26. September 2011 beschlossen.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Futures auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Futures	
						Bar	Phy-sisch
AYOF	Abengoa SA	ES0105200416	ES01	EUR	DE000A1MAHM1	AYO4	n/a

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung*	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
AYOF	100	0,0001	1	XNCFSE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für den neuen Single Stock Future identisch mit denen für die bereits bestehenden Single Stock Futures 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.

Der aktualisierte Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der 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 den neuen SSF stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSFs zur Verfügung:

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > 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 den neuen SSF sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs.

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

8. Positionslimite

Die Positionslimite werden auf der Eurex-Website publiziert unter dem Pfad:

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

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:

http://www.eurexchange.com/trading/products/EQU_de.html

22. September 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 **
[…]						
Abengoa S.A.	AYOF	ES01	XMAD	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

[…]