X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 158/12*

Datum: 24. Juli 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ Aktion erforderlich

Single Stock Futures, Single Stock Dividend Futures: Einführung eines neuen SSF und eines neuen SSDF auf Credit Suisse Group AG aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 154/12

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
Ü Alle Abteilungen	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 Deutschland und Eurex Zürich haben mit Wirkung zum **25. Juli 2012** den folgenden Beschluss gefasst:

Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) und eines neuen Single Stock Dividend Future (SSDF) auf Credit Suisse Group AG (CSGH, C3SG) aufgrund einer Kapitalmaßnahme.

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

ARBN: 101 013 361

Single Stock Futures, Single Stock Dividend Futures: Einführung eines neuen SSF und eines neuen SSDF auf Credit Suisse Group AG aufgrund einer Kapitalmaßnahme

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
CSGH	Credit Suisse Group AG	CH0012138530	CH01	CHF	DE000A1PHW27	CS4H	CS5H
C3SG	Credit Suisse Group AG Dividends	XC000A1HTZS2	CH21	CHF	DE000A1PHW35	------	------

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
CSGH	100	0,0001	1	SNSFSC
C3SG	1000	0,001	1	XNCHYC

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für den neuen SSF und den neuen SSDF identisch mit denen für die bereits bestehenden SSFs bzw. SSDFs 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 Schlussabrechnungspreises 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 Pfad veröffentlicht:

Dokumente > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

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:

Clearing > Risk & Margining > Risikoparameter & Initial Margins

4. Mistrade Parameter und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für den neuen SSF und den neuen SSDF stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSFs bzw. SSDFs zur Verfügung:

Handel & Produkte > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Handel & Produkte > Produkte > Dividendenderivate > Aktien-Dividendenderivate

5. Transaktionslimite

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

Technologie > Transaktionslimite

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für den neuen SSF und den neuen SSDF sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs/SSDFs.

7. Vendorenkürzel

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

Handel & Produkte > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

24. Juli 2012

****

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 **
[…]						
Credit Suisse Group AG	CSGH	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
[…]						

* 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**
[…]						
Credit Suisse Group AG	C3SG	CH21	XVTX	1000	0,001	CHF
[…]						

* 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

[…]