X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 042/09*

Datum: Frankfurt, 18. März 2009
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

⚠ **Aktion erforderlich** ⚠ **Hohe Priorität**

Single Stock Futures: Einführung eines neuen SSF aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 037/09

Kontakt: Christian Csomos (Eurex Product Strategy), Tel. +49-69-211-1 23 94,
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 Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung eines neuen Single Stock Future aufgrund einer Kapitalmaßnahme zum 16. März 2009 beschlossen. Dieses Produkt steht ab dem **18. März 2009** zum Handel auf der Eurex-Plattform zur Verfügung.

Single Stock Futures: Einführung eines neuen SSF aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Einführung eines Single Stock Future

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung eines neuen Single Stock Future aufgrund einer Kapitalmaßnahme zum 16. März 2009 beschlossen. Dieses Produkt steht ab dem 18. März 2009 zum Handel auf der Eurex-Plattform zur Verfügung.

1. Produktüberblick

Futures auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Länder-kennung	Produkt-währung	Produkt-kürzel	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Futures		Kon-trakt-größe	Minimale Preisverän-derung*
						Bar	Phy-sisch		
LAND SECURITIES GROUP	GB0031809436	GB01	GBP	LANG	DE000A0YK2V5	LA4G	----	1000	0,01

* Die minimale Preisveränderung bezieht sich bei Aktien-Futures mit zugewiesener Gruppenkennung GB01 auf Pence.

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für den neuen SSF 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

3. Zulassung zum Block-Trading

Der neue SSF wird zum OTC-Block-Trading zugelassen. Die Mindestgröße für Block Trades wird einen Kontrakt betragen.

4. Produktgruppe

Die Produktgruppe für den neuen SSF ist:

Produktkürzel	LANG
Produktgruppe	XNCFSG

5. 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

6. Mistrade-Parameter

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

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

7. Transaktionslimite

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

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

8. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für den neuen SSF sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs.

9. Vendorenkürzel

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

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

Frankfurt, 18. März 2009

****

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 Preisverän-derung*	Währung
[...]						
Land Securities Group PLC	LANG	GB01	XLON	1000	0,01	GBP
[...]						

* Die minimale Preisveränderung bezieht sich bei Aktien-Futures mit zugewiesener Gruppenkennung GB01 auf Pence.

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

[...]