X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 036/09*

Datum: Frankfurt, 9. März 2009
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Lenz

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

Single Stock Futures: Einführung von vier neuen SSFs

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 030/09, 032/09, 035/09

Kontakt: Christian Csomos (Eurex Product Strategy), Tel. +49-69-211-1 23 94,
E-Mail: christian.csomos@eurexchange.com,
Michael Durica (Eurex Product Strategy), Tel. +49-69-211-1 59 23
E-Mail: michael.durica@eurexchange.com

Zielgruppe:

Ü 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 von vier neuen Single Stock Futures, drei davon aufgrund von Kapitalmaßnahmen, zum **11. März 2009** beschlossen.

Single Stock Futures: Einführung von vier neuen SSFs

Einführung von Single Stock Futures

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von vier neuen Single Stock Futures, drei davon aufgrund von Kapitalmaßnahmen, zum 11. März 2009 beschlossen.

Abweichend von Eurex-Rundschreiben 035/09 wird die **Kontraktgröße** der neuen Futures auf CRH PLC (CRGG) nicht, wie angekündigt 50, sondern **100** sein.

1. Produktüberblick

Futures auf	Basiswert ISIN	Eurex Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-kürzel	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Futures		Kon-trakt-größe	Minimale Preisverän-derung*
						Bar	Phy-sisch		
CRH PLC	IE0001827041	IE01	EUR	CRGG	DE000A0YK2E1	CR4G	----	100	0,0001
Hammerson PLC	GB0004065016	GB01	GBP	HMSG	DE000A0YKYL4	HM4G	----	1000	0,01
MVV Energie AG	DE000A0H52F5	DE01	EUR	MVVF	DE000A0YKYN0	MV4F	MV5F	100	0,0001
Xstrata PLC	GB0031411001	GB01	GBP	XTAG	DE000A0YKYM2	XT4G	----	1000	0,01

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

Bar abgerechnete Flexible Futures werden für alle Single Stock Futures zur Verfügung stehen, während Flexible Futures (sowohl bar abgerechnete als auch physisch gelieferte) nur für die oben angeführten SSFs mit der Gruppenkennung DE01 zur Verfügung stehen werden.

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs 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 Eurex Zürich wird zum Produkteinführungsdatum auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Dokumente > Regelwerke

3. Zulassung zum Block-Trading

Die neuen SSFs werden zum OTC-Block-Trading zugelassen. Die Mindestgröße für Block Trades wird einen Kontrakt betragen.

4. Produktgruppe

Die Produktgruppen für die neuen SSFs sind:

Produktkürzel	CRGG	HMSG	MVVF	XTAG
Produktgruppe	XNCFSE	XNCFSG	ENSFSE	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 die SSFs stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad 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-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

8. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen SSFs 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, 9. 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
[…]						
CRH PLC	CRGG	IE01	XDUB	100	0,0001	EUR
MVV Energie AG	MVVF	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Hammerson PLC	HMSG	GB01	XLON	1000	0,01	GBP
Xstrata PLC	XTAG	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 wird 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.

[…]