X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 005/12*

Datum: 9. Januar 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ **Aktion erforderlich**

Single Stock Futures: Einführung eines neuen SSF sowie eines SSDF auf UniCredit S.p.A. aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 004/12

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

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ 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-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund einer Kapitalmaßnahme die Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) sowie die Einführung eines neuen Single Stock Dividend Future (SSDF) auf UniCredit S.p.A. zum **9. Januar 2012** beschlossen.

Anders als im Eurex Rundschreiben 004/12 angekündigt, wird die Standardkontraktgröße der Aktienoption auf UniCredit S.p.A. (CRI5) nicht geändert und bleibt weiterhin bei 1.000 Kontrakten.

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
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: Einführung eines neuen SSF sowie eines SSDF auf UniCredit S.p.A. aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund einer Kapitalmaßnahme die Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) sowie die Einführung eines neuen Single Stock Dividend Future (SSDF) auf UniCredit S.p.A. zum 9. Januar 2012 beschlossen.

Anders als im Eurex Rundschreiben 004/11 angekündigt, wird die Standardkontraktgröße der Aktienoption auf UniCredit S.p.A. (CRI5) nicht geändert und bleibt weiterhin bei 1.000 Kontrakten.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
CR5I	UniCredit S.p.A.	IT0004781412	IT01	EUR	DE000A1MLFA7	C45I	C55I
C3RI	UniCredit S.p.A. Dividenden	XC000A1DKDP3	IT21	EUR	DE000A1MLFB5	----	-----

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
CR5I	1000	0,0001	1	ENSFSE
C3RI	1000	0,001	1	XNCHYE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für den neuen SSF 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 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 und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für den neuen SSF und 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-Dividendenderivate

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 SSF und den 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

9. Januar 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 **
[…]						
UniCredit S.p.A.	CR5I	IT01	XMIL	1000	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**
[…]						
UniCredit S.p.A.	C3RI	IT21	XMIL	1000	0,001	EUR
[…]						

* 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

[…]