X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 114/12*

Datum: 29. Mai 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ **Aktion erforderlich**

Single Stock Futures, Single Stock Dividend Futures: Einführung von einem SSF und einem SSDF auf Air Liquide S.A. und von SSFs auf ElringKlinger AG, Azimut Holding SpA und Eurazeo aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 073/12, 075/12, 082/12, 086/12,105/12

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 **4. Juni 2012** die folgenden Beschlüsse gefasst:

Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) und eines Single Stock Dividend Future (SSDF) auf Air Liquide S.A. (AIRJ, A3IR), und von SSFs auf ElringKlinger AG (ZILG), Azimut Holding SpA (HDBH) und Eurazeo (RFXH).

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 von einem SSF und einem SSDF auf Air Liquide S.A. und von SSFs auf ElringKlinger AG, Azimut Holding SpA und Eurazeo aufgrund von Kapitalmaßnahmen

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
AIRJ	Air Liquide S.A.	FR0000120073	FR01	EUR	DE000A1PHNK1	AI4J	AI5J
A3IR	Air Liquide Dividends	XC000A1DKC69	FR21	EUR	DE000A1PHNL9	------	-------
ZILG	ElringKlinger AG	DE0007856023	DE01	EUR	DE000A1PHNM7	ZI4G	ZI5G
HDBH	Azimut Holding SpA	IT0003261697	IT01	EUR	DE000A1PHNN5	HD4H	HD5H
RFXH	Eurazeo	FR0000121121	FR01	EUR	DE000A1PHNP0	RF4H	RF5H

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
AIRJ	100	0,0001	1	ENSFSE
A3IR	1000	0,001	1	XNCHYE
ZILG	100	0,0001	1	ENSFSE
HDBH	1000	0,0001	1	ENSFSE
RFXH	100	0,0001	1	ENSFSE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs und den neuen SSDF identisch mit denen für die bereits bestehenden SSFs und 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 die neuen SSFs und den neuen SSDF stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSFs und 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 und SSDFs gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

Technologie > Transaktionslimite

6. Transaktionsentgelte

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

7. Vendorenkürzel

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

Handel & Produkte > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

29. Mai 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 **
[…]						
Air Liquide S.A.	AIRJ	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
ElringKlinger AG	ZILG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Eurazeo	RFXH	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Azimut Holding SpA	HDBH	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**
[…]						
Air Liquide Dividends	A3IR	FR21	XETR	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

[…]