X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 067/13*

Datum: 16. April 2013
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 neuer SSFs auf Swiss Re und SGS S.A. und eines neuen SSDF auf Swiss Re aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 020/13, 033/13

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

Zielgruppe:	**Anhänge:**
➲ Alle Abteilungen	Geänderte Annexe A und D der Kontrakt-spezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen haben aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung neuer Single Stock Futures (SSFs) auf Swiss Re und SGS S.A. sowie die Einführung eines Single Stock Dividend Future (SSDF) auf Swiss Re zum **22. April 2013** beschlossen.

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

ARBN: 101 013 361

Single Stock Futures, Single Stock Dividend Futures: Einführung neuer SSFs auf Swiss Re und SGS S.A. und eines neuen SSDF auf Swiss Re aufgrund von Kapitalmaßnahmen

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex Gruppen-kennung	Produkt währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
S3RE	SWISS RE AG DIVIDENDS	XC000A1HTZW4	CH21	CHF	DE000A1XQU69	-----	-----
SGSL	SGS S.A.	CH0002497458	CH01	CHF	DE000A1XQU36	SG4L	SG5L
SREH	SWISS RE AG	CH0126881561	CH01	CHF	DE000A1XQU28	SR4H	SR5H

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
S3RE	1000	0,001	1	XNCHYC
SGSL	10	0,0001	1	SNSFSC
SREH	100	0,0001	1	SNSFSC

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 Link veröffentlicht:

Ressourcen > 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 Link auf der Eurex-Website veröffentlicht:

Marktdaten > Clearing-Daten > 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:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

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 Link:

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 Link:

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

16. April 2013

****

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 **
[…]						
SGS S.A.	SGSL	CH01	XVTX	10	0,0001	CHF
SWISS RE AG	SREH	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**
[…]						
SWISS RE AG	S3RE	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

[…]