X-pand into the Future

eurex rundschreiben 102/12

Datum: 14. 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: 1. Einführung von SSFs auf Dieteren S.A., AMAG Austria Metall AG und Icade S.A., 2. Einführung eines SSF und SSDF auf Deutsche Börse AG aufgrund einer Kapitalmaßnahme

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 078/12, 072/12

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ 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 haben mit Wirkung zum **18. Mai 2012** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von Single Stock Futures auf Dieteren S.A. (DIEF), AMAG Austria Metall AG (AM8F) und Icade S.A. (ICAF).
2. Einführung eines neuen SSF und Single Stock Dividend Future (SSDF) auf Deutsche Börse AG (DB1H, D3B1) aufgrund einer Kapitalmaßnahme.

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

ARBN: 101 013 361

Single Stock Futures, Single Stock Dividend Futures: 1. Einführung von SSFs auf Dieteren S.A., AMAG Austria Metall AG und Icade S.A., 2. Einführung eines SSF und SSDF auf Deutsche Börse AG aufgrund einer Kapitalmaßnahme

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
DB1H	Deutsche Börse AG	DE0005810055	DE01	EUR	DE000A1PHMG1	D41H	D51H
DIEF	Dieteren S.A	BE0974259880	BE01	EUR	DE000A1PHMW8	D4IF	D5IF
D3B1	Deutsche Börse Dividends	XC000A1DKDB3	DE21	EUR	DE000A1PHMH9	-------	------
AM8F	AMAG Austria Metall AG	AT00000AMAG3	AT01	EUR	DE000A1PHM60	A48F	A58F
ICAF	Icade S.A.	FR0000035081	FR01	EUR	DE000A1PHM78	IC4F	IC5F

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
DB1H	100	0,0001	1	ENSFSE
DIEF	100	0,0001	1	ENSFSE
D3B1	1000	0,001	1	XNCHYE
AM8F	100	0,0001	1	ENSFSE
ICAF	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

14. 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 **
[…]						
AMAG Austria Metall AG	AM8F	AT01	XVIE	100	0,0001	EUR
Deutsche Boerse AG	DB1H	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Dieteren S.A	DIEF	BE01	XBRU	100	0,0001	EUR
Icade S.A	ICAF	FR01	XPAR	100	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**
[…]						
Deutsche Boerse Dividends	D3B1	DE21	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

[…]