X-pand into the Future

eurex rundschreiben 093/16

Datum: 10. Oktober 2016
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

⚠ **Aktion erforderlich**

Aktien-Futures: Einführung von einem Aktien-Future; Aktiendividenden-Futures: Einführung von einem Aktiendividenden-Future

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10,
Dr. Michael Durica, T +49-69-211-1 59 23, michael.durica@eurexchange.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderte Annexe A und D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben mit Wirkung zum **13. Oktober 2016** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von einem Aktien-Future gemäß Annex A aus dem Anhang.
2. Einführung von einem Aktiendividenden-Future gemäß Annex D aus dem Anhang.

.

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, Mehtap
Dinc, Erik Tim Müller,
Michael Peters,
Dr. Randolf Roth
ARBN: 101 013 361

A. Aktien-Futures: Einführung von einem Aktien-Future; B. Aktiendividenden-Futures: Einführung von einem Aktiendividenden-Future

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future/Dividenden-Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN
AIRL	Air Liquide S. A.	FR0000120073	FR01	EUR	DE000A2BMRG8
A5IR	Air Liquide S. A.	XC000A1DKC69	FR21	EUR	DE000A2BMRH6

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
AIRL	100	0,0001	1	ENSFSE
A5IR	1000	0,001	1	XNCHYE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Aktien-Futures und die neuen Aktiendividenden-Futures identisch mit denen für die bereits bestehenden Aktien-Futures bzw. Aktiendividenden-Futures 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 Schluss-abrechnungspreises zu.

Die aktualisierten Annexe A und D der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich werden auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

3. Risikoparameter

Die gültigen Risikoparameter werden nach deren Aufsetzen in T7 von Eurex Exchange per „Theoretical Price Files“ übertragen. Mit Handelsstart werden die Parameter auch unter dem folgenden Link auf der Eurex-Website veröffentlicht:

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Derzeit sind alle zum Handel zugelassenen Derivate auf Aktien, Aktienindizes, Fixed Income- und Geldmarkt-instrumente sowie alle OTC IRS-Produkte für die Berechnung in Eurex Clearing Prisma zugelassen.

Die Risikoparameter für die neuen Produkte finden Sie auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link:

Risikomanagement > Risikoparameter

Dort finden Sie auch eine aktuelle Liste mit Details zu allen Prisma-fähigen Eurex-Produkten.

4. Mistrade-Parameter und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für die neuen Aktien-Futures und die neuen Aktiendividenden-Futures stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter den folgenden Links zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Produkte > Dividendenderivate > Aktien-Dividendenderivate

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Werte wie für schon bestehende Aktien-Futures und Aktiendividenden-Futures gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Technologie > Entgelt für exzessive Systemnutzung

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen Produkte gelten analog zu den entsprechenden bestehenden Aktien-Futures bzw. Aktiendividenden-Futures.

7. Vendorenkürzel

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

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

10. Oktober 2016

****

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.	AIRL	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 1.14 der Kontraktspezifikationen:

Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden ("Aktiendividenden-Futures")	Produkt-kennung	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Wäh-rung**
[…]						
Air Liquide S.A.	A5IR	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

[…]

****