X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 122/12*

Datum: 30. Mai 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ **Aktion erforderlich**

Single Stock Futures: Einführung von SSFs auf Facebook Inc. und Validus Holdings Ltd.

Kontakt: Dr. Michael Durica, Eurex Product Development, Tel. +49-69-211-1 59 23,
E-Mail: michael.durica@eurexchange.com

Zielgruppe:

Ü Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderter Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen haben die Einführung von neuen Single Stock Futures (SSFs) auf Facebook Inc. (FBF) und Validus Holdings Ltd. (VALF) zum **1. Juni 2012** beschlossen.

Single Stock Futures: Einführung von SSFs auf Facebook Inc. und Validus Holdings Ltd.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
FBF	Facebook Inc.	US30303M1027	US02	USD	DE000A1PHN69	FB4F	n/a
VALF	Validus Holdings Ltd.	BMG9319H1025	US01	USD	DE000A1PHN77	VA4F	n/a

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
FBF	100	0,0001	1	XNCFSU
VALF	100	0,0001	1	XNCFSU

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs identisch mit denen für die bereits bestehenden SSFs 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.

Der aktualisierte Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich wird 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 stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSFs zur Verfügung:

Handel & Produkte > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs 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 sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs.

7. Vendorenkürzel

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

Handel & Produkte > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

30. 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 **
[…]						
Facebook Inc.	FBF	US02	XNAS	100	0,0001	USD
Validus Holdings Ltd.	VALF	US01	XNYS	100	0,0001	USD
[…]						

* 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

[…]