X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 137/12*

Datum: 15. Juni 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

⚠ Aktion erforderlich

Single Stock Dividend Futures: Einführung von zwei neuen SSDFs auf ASML Holding N.V. und Essilor International S.A.

Verweis auf Eurex-Rundschreiben:

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
Ü Alle Abteilungen	Geänderter Annex 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 und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben mit Wirkung zum **22. Juni 2012** den folgenden Beschluss gefasst:

Einführung von zwei neuen Single Stock Dividend Futures (SSDFs) auf ASML Holding N.V. (A2SM) und Essilor International S.A. (E2SL).

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 Dividend Futures: Einführung von zwei neuen SSDFs auf ASML Holding N.V. und Essilor International S.A.

1. Produktüberblick

Single Stock Dividend Future auf	Single Stock Dividend Future			Technischer Basiswert des Single Stock Dividend Future	
	Eurex-Produktkürzel	Eurex-Produkt-ISIN	Eurex-Produktwährung	Basiswert-Kürzel	Basiswert-ISIN
ASML Holding N.V.	A2SM	DE000A1PHSN4	EUR	A2SD	XC000A1PHSP1
Essilor International S.A.	E2SL	DE000A1PHSQ7	EUR	E2SD	XC000A1PHSR7

Produktkürzel	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe	Eurex-Gruppenkennung
A2SM	1000	0,001	1	XNCHYE	NL21
E2SL	1000	0,001	1	XNCHYE	FR21

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

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

Der aktualisierte Annex 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 SSDFs stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSDFs zur Verfügung:

Handel & Produkte > Produkte > Dividendenderivate > Aktien-Dividendenderivate

5. Market-Making

Die neuen SSDFs auf ASML Holding N.V. (A2SM) und Essilor International S.A. (E2SL) werden ab dem 1. Juli 2012 Bestandteil des bestehenden Designated Market-Making (DMM)-Pakets für SSDFs auf Komponenten des EURO STOXX 50®-Index sein.

Detaillierte Informationen zu den angepassten DMM-Verpflichtungen werden zeitnah in einem separaten Eurex-Rundschreiben veröffentlicht.

6. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSDFs gemäß der Eurex-Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

Technologie > Transaktionslimite

7. Transaktionsentgelte

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

8. Vendorenkürzel

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

Handel & Produkte > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

15. Juni 2012

****

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

****

[…]

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**
[…]						
ASML Dividend Futures	A2SM	NL21	XAMS	1000	0,001	EUR
Essilor Dividend Futures	E2SL	FR21	XPAR	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

[…]