X-pand into the Future

eurex rundschreiben 085/17

Datum: 4. August 2017
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Michael Peters

⚠ **Aktion erforderlich**

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

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +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 Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben mit Wirkung zum **10. August 2017** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von drei Aktien-Futures 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

Internet:
www.eurexchange.com

Geschäftsführung:
Dr. Thomas Book,
Mehtap Dinc, Erik Tim Müller,
Michael Peters, Dr. Randolf Roth

ARBN: 101 013 361

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

1. Produktüberblick

Eurex-Produktkürzel	Future/ Aktiendividenden-Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppenkennung	Produktwährung	Produkt-ISIN
FIAJ	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	NL0010877643	IT01	EUR	DE000A2GGF86
GI6G	GECINA S.A.	FR0010040865	FR01	EUR	DE000A2GGF94
S3SD	Banco Santander S.A.	XC000A1CRK97	ES21	EUR	DE000A2GGF78
SANH	Banco Santander S.A.	ES0113900J37	ES01	EUR	DE000A2GGF60

Eurex-Produktkürzel	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe
FIAJ	1000	0,0001	1	ENSFSE
GI6G	100	0,0001	1	ENSFSE
S3SD	1000	0,001	1	XNCHYE
SANH	100	0,0001	1	XNCFSE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Aktien-Futures und den neuen Aktiendividenden-Future 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 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 Handelsstart 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 Geldmarktinstrumente 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 den neuen Aktiendividenden-Future stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter den folgenden Links zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Produkte > Aktienderivate > Aktiendividendenderivate

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

4. August 2017

****

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 **
[…]						
Banco Santander S.A.	SANH	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Fiat Chrysler Automobiles N.V.	FIAJ	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
GECINA S.A.	GI6G	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**
[…]						
Banco Santander S.A.	S3SD	ES21	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

[…]

[…]

****