X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 030/12*

Datum: 16. Februar 2012
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

Aktion erforderlich

Single Stock Futures: Einführung eines neuen SSF sowie eines neuen SSDF auf GlaxoSmithKline PLC aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 022/12

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

Zielgruppe:

Ü 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 Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) sowie die Einführung eines Single Stock Dividend Future (SSDF) auf GlaxoSmithKline PLC zum **20. Februar 2012** beschlossen. Details entnehmen Sie bitte diesem Rundschreiben.

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
customer.support@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexchange.com

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

ARBN: 101 013 361

Single Stock Futures: Einführung eines neuen SSF sowie eines neuen SSDF auf GlaxoSmithKline PLC aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung eines neuen Single Stock Future (SSF) sowie die Einführung eines neuen Single Stock Dividend Future (SSDF) auf GlaxoSmithKline PLC zum 20. Februar 2012 beschlossen.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Phy-sisch
GSKG	Glaxosmithkline Plc.	GB0009252882	GB01	GBX	DE000A1N5H32	GS4G	GS5G
G3SK	Glaxosmithkline Dividend	XC000A1KD0Y5	GB21	GBX	DE000A1N5H24	----	-----

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung	Mindest-größe für Block Trades	Produkt-gruppe
GSKG	1000	0,0001	1	XNCFSG
G3SK	1000	0,01	1	XNCHYG

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für den neuen SSF und den neuen SSDF identisch mit denen für die bereits bestehenden SSFs und SSDFs 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.

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 unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Dokumente > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/documents/regulations/contract_specifications_de.html

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:

www.eurexchange.com > Clearing > Risk & Margining > Risikoparameter & Initial Margins

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:

http://www.eurexchange.com/clearing/risk/parameters_de.html

4. Mistrade-Parameter und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für den neuen SSF und den neuen SSDF stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem entsprechenden Pfad für SSFs bzw. SSDFs zur Verfügung:

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

bzw.

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > Produkte > Dividendenderivate > Aktien-Dividendenderivate

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf den entsprechenden Link:

http://www.eurexchange.com/trading/products/EQU/FUT/products_de.html

http://www.eurexchange.com/trading/products/DID/EDF/products_de.html

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:

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:

http://www.eurexchange.com/technology/transaction_limits_de.html

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für den neuen SSF und den neuen SSDF sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs und SSDFs.

7. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel entnehmen Sie bitte ab Handelsstart unserer Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Handel & Produkte > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern

Zur direkten Weiterleitung zum Dokument klicken Sie auf folgenden Link:

http://www.eurexchange.com/trading/products/vendor_product_code_search_de.html

16. Februar 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 **
[…]						
GLAXOSMITHKLINE PLC	GSKG	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
[…]						

* 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**
[…]						
GLAXOSMITHKLINE PLC	G3SK	GB21	XLON	1000	0,01	GBX
[…]						

* 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

[…]