X-pand into the Future

eurex rundschreiben 103/16

Datum: 1. November 2016
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

⚠ Aktion erforderlich

Aktienderivate: Einführung eines Aktien-Futures und einer Aktienoption auf innogy SE

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10, Christine Heyde, T +49-69-211-1 56 98

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderte Annexe A und B 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 **7. November 2016** den folgenden Beschluss gefasst:

1. Einführung eines Aktien-Futures auf innogy SE gemäß Annex A aus dem Anhang.
2. Einführung einer Aktienoption auf innogy SE gemäß Annex B 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

Aktienderivate: Einführung eines Aktien-Futures und einer Aktienoption auf innogy SE

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben mit Wirkung zum 7. November 2016 den folgenden Beschluss gefasst:

1. Einführung eines Aktien-Futures auf innogy SE gemäß Annex A aus dem Anhang.
2. Einführung einer Aktienoption auf innogy SE gemäß Annex B aus dem Anhang.

A. Aktien-Futures: Einführung eines Aktien-Futures auf innogy SE

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Future	
						Bar	Physisch
IGYF	innogy SE	DE000A2AADD2	DE01	EUR	DE000A2DBJ31	IG4F	IG5F

Produkt-kürzel	Kontraktgröße	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe
IGYF	100	0,0001	1	ENSFSE

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für den neuen Aktien-Future identisch mit denen für die bereits bestehenden Aktien-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.

Der aktualisierte Annex A 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 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

Der neue Aktien-Future wird dem Prisma-Margining unterliegen.

Die Risikoparameter das neue Produkt finden Sie auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link:

Risikomanagement > Risikoparameter

4. Mistrade-Parameter und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für den neuen Aktien-Future stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Werte wie für schon bestehende Aktien-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 den neuen Aktien-Future sind analog zu den entsprechenden bestehenden Aktien-Futures.

7. Vendorenkürzel

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

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

B. Aktienoptionen: Einführung einer Aktienoption auf innogy SE

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Option auf	Produkt-ISIN Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Maximale Laufzeit in Monaten
IGY	innogy SE	DE000A2AADD2	DE12	EUR	60

Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
IGY	100	0,01	1	ENSOEE

Der aktualisierte Annex B der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich werden zum Einführungsdatum des neuen Produktes auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

2. Ausübungspreise

Die Aktienoption folgt dem aktuellen Eurex-Standard für Ausübungspreise der jeweiligen Gruppenkennung. Die Ausübungspreise sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

Die Kontraktspezifikationen für das neue Produkt stehen auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

3. Risikoparameter

Die Margin-Parameter werden rechtzeitig auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Die neue Aktienoption wird dem Prisma-Margining unterliegen.

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

Risikomanagement > Risikoparameter

4. Handelszeiten

Die Handelszeiten für die neue Aktienoption entsprechen den jeweils gültigen Handelszeiten für die bereits vorhandenen Eurex-Gruppenkennungen und sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

5. Mistrade Ranges, Positionslimite

Die Mistrade Ranges und Positionslimite für die neue Aktienoption werden ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

6. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel für das neue Produkt entnehmen Sie bitte ab Handelsstart der Eurex-Website unter dem Link:

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

7. Handelskalender

Es gilt der bestehende Handelskalender für deutsche Aktienoptionen. Die Handelskalender finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Handel > Handelskalender

8. Transaktionslimite, Mindestgröße für Cross- und Pre-arranged Trades, Transaktionsentgelte

Es gelten die gleichen Werte wie für bestehende Aktienoptionen mit der entsprechenden Eurex-Gruppenkennung.

9. Eurex-Trade-Entry-Services

Die Flexible Options-Funktionalität wird unter Anerkennung der Allgemeinen Teilnahmebedingungen zur Verfügung stehen.

Eine Übersicht der für die Produkte zur Verfügung stehenden Eurex Trade Entry Services sowie detaillierte Angaben zu allen Aktien-Futures und -optionen auf Einzelproduktbasis hinsichtlich deren Verfügbarkeit, Nutzungsmöglichkeiten und Mindesteingabegrößen zu den verschiedenen Eurex Trade Entry Services finden Sie auf der Eurex-Website www.eurexchange.com.

In der Excel-Datei „Eurex Produktliste und Produktgruppen“ ist der Produktparameter „Block Volume Publication Limit“ (siehe Spalte „Blk Vol Pub Limit“) angegeben, der die Obergrenze für die Volumina angibt,

bis zu welcher Eurex Block Trades in den verschiedenen Produkten veröffentlicht werden. Vorgenannte Informationen sowie die Excel-Datei sind verfügbar auf der Eurex-Website unter dem Link:

Produkte > Eurex Trade Entry Services > TES-Parameter

1. November 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 **
[…]						
innogy SE	IGYF	DE01	XETR	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 B zu Ziffer 2.6 der Kontraktspezifikationen:

Optionen auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Maximale Laufzeit (Monate)	Minimale Preisver-änderung	Währung **
[…]							
innogy SE	IGY	DE12	XETR	100	60	0,01	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

[…]

****