



eurex clearing

rundschreiben 108/15

Datum: 21. September 2015
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendors
Autorisiert von: Heike Eckert

**Aktiendividenden-Futures: Einführung eines Futures-Kontrakts auf
Aktiendividenden der Fresenius SE & Co. KGaA aufgrund der Aufnahme
in den EURO STOXX 50®-Index**

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 170/15

Kontakt: Derivatives Clearing Supervision, T +49-69-211-1 12 50, clearing@eurexclearing.com,
 Risk Control, T +49-69-211-1 24 52, risk@eurexclearing.com

Zielgruppe:

➔ Alle Abteilungen

Anhang:

Transaktionsentgelte für Aktiendividenden-Futures für den Zeitraum vom 28. September 2015 bis 31. August 2016

Zusammenfassung:

Mit Wirkung zum **28. September 2015** bietet Eurex Clearing das Clearing des an Eurex Exchange eingeführten Futures-Kontrakts auf Aktiendividenden der Fresenius SE & Co. KGaA aufgrund der Aufnahme in den EURO STOXX 50®-Index an.

Ab dem 28. September 2015 werden für diesen neuen Aktiendividenden-Future Market-Making-Rabatte gemäß der Ausgestaltung der bestehenden Rabattprogramme für das jeweilige Designated Market-Making-Paket gewährt.

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Clearing des Produkts. Die genannten Änderungen werden zum 28. September 2015 wirksam.

Weitere handelsspezifische Informationen entnehmen Sie bitte Eurex-Rundschreiben 170/15.

**Aktiendividenden-Futures: Einführung eines Futures-Kontrakts auf
Aktiendividenden der Fresenius SE & Co. KGaA aufgrund der Aufnahme
in den EURO STOXX 50®-Index**

Mit Wirkung zum 28. September 2015 bietet Eurex Clearing das Clearing des an Eurex Exchange eingeführten Futures-Kontrakts auf Aktiendividenden der Fresenius SE & Co. KGaA aufgrund der Aufnahme in den EURO STOXX 50®-Index an.

Dieses Rundschreiben enthält Informationen zum Clearing des Produkts. Die genannten Änderungen werden zum 28. September 2015 wirksam.

1. Produktüberblick

Aktiendividenden-Future auf	Aktiendividenden-Future			Technischer Basiswert des Aktiendividenden-Future	
	Eurex-Produktkürzel	Eurex-Produkt-ISIN	Eurex-Produktwährung	Basiswert-Kürzel	Basiswert-ISIN
Fresenius SE & Co. KGaA	F2RE	DE000A1637M0	EUR	F2RD	XC000A1637L0

Eurex-Produktkürzel	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe	Eurex-Gruppenkennung	Produkttyp
F2RE	1000	0,001	1	XETR	DE21	FSTK

Grundsätzlich sind die Kontraktpezifikationen für den neuen Aktiendividenden-Future identisch mit denen für die bereits bestehenden 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.

Der aktualisierte Annex D der Kontraktpezifikationen 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 > Kontraktpezifikationen

2. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte werden entsprechend der jeweiligen Gruppenkennung festgelegt. Die regulären Entgelte sind wie folgt:

Aktiendividenden-Futures mit Gruppenkennung entsprechend Annex D der Eurex-Kontraktpezifikationen	Dividende	Währung	Reguläre Transaktionen	Block Trades
DE21	>= 1,00	EUR	1,20	1,80
	0,75 – 0,99	EUR	1,00	1,50
	0,50 – 0,74	EUR	0,80	1,20
	0,25 – 0,49	EUR	0,60	0,90
	< 0,25	EUR	0,20	0,30

Weitere Details entnehmen Sie bitte dem aktuellen Preisverzeichnis der Eurex Clearing AG auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem Link:

Ressourcen > Regelwerke > Preisverzeichnis

Die genaue Höhe der Transaktionsentgelte je Aktiendividenden-Future entnehmen Sie dem Anhang dieses Rundschreibens.

3. Eurex-Trade-Entry-Services

Die Mindestanzahl zu handelnder Kontrakte des neuen Aktiendividenden-Future mittels der Eurex Block Trade-Services beträgt einen Kontrakt.

Teilnehmer, die die Eurex-Trade-Entry-Services neu nutzen wollen, sollten durch Unterzeichnung und Rücksendung der entsprechenden Erklärung ihre Anerkennung der Allgemeinen Teilnahmebedingungen bestätigen. Außerdem sollte bei Nicht-Clearing-Mitgliedern gleichzeitig deren Clearing-Mitglied die entsprechende Anerkennungserklärung unterzeichnen und zurücksenden. Die erforderlichen Formulare finden Sie auf der Eurex Clearing-Website unter dem Link:

Ressourcen > Formulare > Eurex Trade Entry Services

4. Risikoparameter

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

Risikomanagement > Risikoparameter

21. September 2015

Transaktionsentgelte für Aktiendividenden-Futures für den Zeitraum vom 28. September 2015 bis 31. August 2016

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
BE21	I2TK	Anheuser-Busch-InBev Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
CH21	A2BB	ABB Dividend Futures	1,10	1,65	1,10	CHF
CH21	A2DE	Adecco Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	B2AE	Julius Bär Gruppe Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	C2FR	Cie Financière Richemont Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	C2SG	Credit Suisse Group Dividend Futures	1,10	1,65	1,10	CHF
CH21	C3SG	Credit Suisse Group Dividend Futures	1,10	1,65	1,10	CHF
CH21	G2EB	Geberit Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	G2IV	Givaudan Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	H2OL	Holcim Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	N2ES	Nestlé Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	N2OV	Novartis Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	R2OG	Roche Holding Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S2CM	Swisscom Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S2GS	SGS Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S2RE	Swiss Re Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S2YN	Syngenta Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S3RE	Swiss Re Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	S4RE	Swiss Re Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF

Gruppen- kennung	Produkt- ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch- Geschäfte	Off-Book- Geschäfte	Barausgleich	Währung
CH21	S5RE	Swiss Re Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	U2BS	UBS Dividend Futures	1,10	1,65	1,10	CHF
CH21	U2HR	Swatch Group Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
CH21	Z2UR	Zurich Financial Services Dividend Futures	1,60	2,40	1,60	CHF
DE21	A2DS	Adidas Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	A2LV	Allianz Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	B2AS	BASF Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	B2AY	Bayer Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	B2MW	BMW Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	C2ON	Continental Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	D2AI	Daimler Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	D2BK	Deutsche Bank Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
DE21	D2PW	Deutsche Post Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
DE21	D2TE	Deutsche Telekom Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
DE21	D3B1	Deutsche Börse Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	D3BK	Deutsche Bank Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
DE21	E2OA	E.ON Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
<u>DE21</u>	<u>F2RE</u>	<u>Fresenius Dividend Futures</u>	<u>0,60</u>	<u>0,90</u>	<u>0,60</u>	<u>EUR</u>
DE21	H2EN	Henkel pref. Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	L2HA	Lufthansa Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
DE21	L2IN	Linde Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR

Gruppen- kennung	Produkt- ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch- Geschäfte	Off-Book- Geschäfte	Barausgleich	Währung
DE21	M2EO	Metro Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
DE21	M2RK	Merck Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	M2UV	Münchener Rück Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	R2WE	RWE Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	R3WE	RWE Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
DE21	S2AP	SAP Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	S2DF	K+S Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
DE21	S2IE	Siemens Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	S3AP	SAP Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	S3IE	Siemens Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
DE21	T2KA	ThyssenKrupp Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
DE21	V2W3	VW pref. Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
ES21	B3BV	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
ES21	I2BE	Iberdrola Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
ES21	I3XD	Inditex Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
ES21	I4XD	Inditex Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
ES21	I5XD	Inditex Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
ES21	I6XD	Inditex Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
ES21	R2EP	Repsol Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
ES21	R3EP	Repsol Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
ES21	S2SD	Banco Santander Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR

Gruppen- kennung	Produkt- ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch- Geschäfte	Off-Book- Geschäfte	Barausgleich	Währung
ES21	T3NE	Telefónica Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
FI21	N2OA	Nokia Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
FI21	N3OA	Nokia Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
FR21	A2CR	Accor Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
FR21	A2OM	ALSTOM Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
FR21	A2XA	AXA Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
FR21	A3IR	Air Liquide Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	A4IR	Air Liquide Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	B2NP	BNP Paribas Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	B2SN	Danone Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	B2YG	Bouygues Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	C2AR	Carrefour Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
FR21	C3AR	Carrefour Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
FR21	E2AS	Airbus Group Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	E2DF	Electricité de France Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	E2SL	Essilor International Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	F2TE	Orange Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
FR21	G2OB	Saint-Gobain Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	G2ZF	ENGIE Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
FR21	L2OR	L'Oréal Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	M2OH	LVMH Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
FR21	M3OH	LVMH Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	P2ER	Pernod-Ricard Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	P2PX	Kering Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	P2U4	Publicis Groupe Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	R2NL	Renault Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2EJ	Safran Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2GE	Société Générale Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2ND	Schneider Electric Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2NW	Sanofi Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S2QU	Vinci Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	S3ND	Schneider Electric Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	T2OT	TOTAL Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	V2AC	Vallourec Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
FR21	V2VD	Veolia Environnement Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
FR21	V2VU	Vivendi Universal Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	V3VU	Vivendi Universal Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	V4VU	Vivendi Universal Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
FR21	X2CA	Crédit Agricole Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
GB21	A2V	Aviva Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	B2A	BAE Systems Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	B2AR	Barclays Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP

Gruppen- kennung	Produkt- ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch- Geschäfte	Off-Book- Geschäfte	Barausgleich	Währung
GB21	B2AT	British American Tobacco Dividend Futures	0,30	0,45	0,30	GBP
GB21	B2G	BG Group Dividend Futures	0,10	0,15	0,10	GBP
GB21	B2P	BP Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	B2T	BT Group Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	B3AR	Barclays Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	C2NA	Centrica Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	D2GE	Diageo Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	GBP
GB21	G3SK	GlaxoSmithKline Dividend Futures	0,26	0,39	0,26	GBP
GB21	M2RW	WM Morrison Supermarkets Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	N2G	National Grid Dividend Futures	0,10	0,15	0,10	GBP
GB21	R2TZ	Rio Tinto Dividend Futures	0,30	0,45	0,30	GBP
GB21	S2SE	SSE Dividend Futures	0,26	0,39	0,26	GBP
GB21	S2VT	Severn Trent Dividend Futures	0,26	0,39	0,26	GBP
GB21	T2SC	Tesco Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	V2O	Vodafone Group Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	V3O	Vodafone Group Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB21	V4O	Vodafone Group Dividend Futures	0,04	0,06	0,04	GBP
GB22	A2AL	Anglo American Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	USD
GB22	A2ZN	AstraZeneca Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
GB22	B2LT	BHP Billiton Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
GB22	B3LT	BHP Billiton Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD

Gruppen- kennung	Produkt- ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch- Geschäfte	Off-Book- Geschäfte	Barausgleich	Währung
GB22	H2SB	HSBC Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	USD
GB23	R2DA	Royal Dutch Shell Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
IE21	C2RG	CRH Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
IT21	A2SG	Assicurazioni Generali Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
IT21	C3RI	UniCredit Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	E2NL	Enel Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	E2NT	Eni Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
IT21	I2ES	Intesa Sanpaolo Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	I3ES	Intesa Sanpaolo Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	T2NE	Telefónica Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
IT21	T2QI	Telecom Italia Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
IT21	U2EI	Terna Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	A2EN	AEGON Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	A2HO	Ahold Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
NL21	A2KU	Akzo Nobel Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
NL21	A2SM	ASML Holding Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
NL21	D2SM	Koninklijke DSM Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
NL21	I2NN	ING Dividend Futures	0,80	1,20	0,80	EUR
NL21	I2SP	Arcelor Mittal Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	K2PN	Royal KPN Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR
NL21	K3PN	Royal KPN Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	EUR

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
NL21	L2DV	Gemalto Dividend Futures	0,60	0,90	0,60	EUR
NL21	P2HI	Philips Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	EUR
NL21	U2BL	Unibail-Rodamco Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
NL21	U2NI	Unilever NV Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	EUR
US21	B2AC	Bank of America Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	USD
US21	B2MY	Bristol-Myers Squibb Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	C2IT	Citigroup Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	USD
US21	C2VX	Chevron Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	G2EC	General Electric Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	USD
US21	I2BM	IBM Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	J2NJ	Johnson & Johnson Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	J2PM	JPMorgan Chase Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	K2OF	The Coca-Cola Company Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	M2CD	McDonald's Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	M2MM	3M Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	M2OF	Altria Group Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	P2EP	PepsiCo Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	P2FE	Pfizer Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	P2M	Philip Morris International Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US21	W2MT	Wal-Mart Stores Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD
US22	A2AP	Apple Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD

Gruppenkennung	Produkt-ID	Produktname	Entgelt pro Kontrakt			
			Orderbuch-Geschäfte	Off-Book-Geschäfte	Barausgleich	Währung
US22	A2MZ	Amazon.com Dividend Futures	0,20	0,30	0,20	USD
US22	C2SC	Cisco Systems Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	USD
US22	I2NT	Intel Dividend Futures	1,00	1,50	1,00	USD
US22	M2ST	Microsoft Dividend Futures	1,20	1,80	1,20	USD

Die Zuordnung des Entgeltes eines einzelnen Aktiendividenden-Futures basiert auf der für den Aktiendividenden-Future maßgeblichen Dividende am jeweiligen Stichtag mit Wirksamkeit zum 1. September jeden Jahres und wird jeweils durch Rundschreiben bekannt gegeben. Stichtag ist der letzte Handelstag im Juli eines jeden Jahres.

Wird in einem Aktiendividenden-Future aufgrund einer Kapitalmaßnahme in der zugrundeliegenden Aktie ein Nachfolgeprodukt zum Handel zugelassen, gelten die dem Vorgängerprodukt zugewiesene Transaktionsentgelte auch für das Nachfolgeprodukt.