X-pand into the Future

eurex rundschreiben 046/17

Datum: 19. Mai 2017
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

⚠ Aktion erforderlich

Aktien-Futures: Einführung von sechs Aktien-Futures; Aktiendividenden-Futures: Einführung von drei Aktiendividenden-Futures

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10,
Dr. Michael Durica, T +49-69-211-1 59 23

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Alle Abteilungen	Geänderte Annexe A und D der Kontrakt-spezifikationen 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 24. Mai 2017** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von sechs Aktien-Futures gemäß Annex A aus dem Anhang;
2. Einführung von drei Aktiendividenden-Futures gemäß Annex D aus dem Anhang.

Aktien-Futures: Einführung von sechs Aktien-Futures; Aktiendividenden-Futures: Einführung von drei Aktiendividenden-Futures

1. Produktüberblick

Eurex-Produktkürzel	Future/Dividenden-Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppenkennung	Produktwährung	Produkt-ISIN
C5SG	Credit Suisse Group AG	XC000A1HTZS2	CH21	CHF	DE000A2GF6A7
CSGJ	Credit Suisse Group AG	CH0012138530	CH01	CHF	DE000A2GF6B5
DVCG	Davide Campari-Milano S.p.A.	IT0005252207	IT01	EUR	DE000A2GF6C3
HNRK	HANNOVER RÜCK SE	DE0008402215	DE01	EUR	DE000A2GF6D1
IHGG	Intercontinental Hotels Group PLC	GB00BD8QVH41	GB01	GBX	DE000A2GF6E9
K6PN	Koninklijke KPN N.V.	XC000A1PHTY1	NL21	EUR	DE000A2GF6F6
KPNJ	Koninklijke KPN N.V.	NL0000009082	NL01	EUR	DE000A2GF6G4
N3G	National Grid PLC	XC000A13RMY5	GB21	GBX	DE000A2GF6H2
NGFG	National Grid PLC	GB00B08SNH34	GB01	GBX	DE000A2GF6J8

Eurex-Produktkürzel	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe
C5SG	1000	0,001	1	XNCHYC
CSGJ	100	0,0001	1	SNSFSC
DVCG	1000	0,0001	1	ENSFSE
HNRK	100	0,0001	1	ENSFSE
IHGG	1000	0,0001	1	XNCFSG
K6PN	1000	0,001	1	XNCHYE
KPNJ	100	0,0001	1	ENSFSE
N3G	1000	0,01	1	XNCHYG
NGFG	1000	0,0001	1	XNCFSG

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Aktien-Futures und die neuen Aktiendividenden-Futures 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 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

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 die neuen Aktiendividenden-Futures stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter den folgenden Links zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Produkte > Dividendenderivate > 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 Aktien-Futures und Aktiendividenden-Futures sind 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

19. Mai 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 **
[…]						
Credit Suisse Group AG	CSGJ	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
Davide Campari-Milano S.p.A.	DVCG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
HANNOVER RÜCK SE	HNRK	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Intercontinental Hotels Group PLC	IHGG	GB01	XLON	1000	0,0001	GBX
Koninklijke KPN N.V.	KPNJ	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
National Grid PLC	NGFG	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 1.14 der Kontraktspezifikationen:

Futures-Kontrakte auf Aktiendividenden ("Aktiendividenden-Futures")	Produkt-kennung	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Minimale Preisver-änderung	Wäh-rung**
[…]						
Credit Suisse Group AG	C5SG	CH21	XVTX	1000	0,001	CHF
Koninklijke KPN N.V.	K6PN	NL21	XETR	1000	0,001	EUR
National Grid PLC	N3G	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

[…]

****