X-pand into the Future

eurex *rundschreiben 041/11*

Datum: 16. Februar 2011
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

Single Stock Futures: Einführung von 72 SSFs aufgrund der Harmonisierung von Kontraktgrößen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 174/10
Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 098/10, 004/11

Kontakt: Dr. Weiwei Wang, Product Development, Tel. +49-69-211-1 72 62,
E-Mail: weiwei.wang@eurexchange.com,
Dr. Michael Durica, Product Development, Tel. +49-69-211-1 59 23,
E-Mail: michael.durica@eurexchange.com

Zielgruppe:

➲ Alle Abteilungen

Anhänge:

1. Geänderte Abschnitte von Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich
2. Single Stock Futures: Quotierungsverpflichtungen für Designated Market-Making

Zusammenfassung:

Wie im Eurex Clearing Rundschreiben 098/10 angekündigt, haben die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG die Harmonisierung der Kontraktgrößen für Single Stock Futures (SSFs) beschlossen. Dies erfolgt durch die Einführung von 72 neuen SSFs mit einer neuen Kontraktgröße und Produkt-ISIN sowie einem neuen Produkt-Kürzel jeweils zum **11., 18. und 25. März** sowie zum **1. April 2011**. 61 der 72 neuen SSFs (85 Prozent) werden eine erhöhte Kontraktgröße haben, so dass Marktteilnehmer dadurch von einer Ersparnis der Transaktionsentgelte profitieren. Mit der Einführung der 72 neuen SSFs werden die Quotierungsverpflichtungen für das Designated Market-Making-Programm in SSFs zum **1. April 2011** angepasst (Anhang 2).

Das Rundschreiben enthält folgende Informationen:

A. Produktinformationen
B. Schrittweise Einstellung des Handels und des Clearing für die bestehenden 72 SSFs auf dieselben Basiswerte
C. Anpassung der Quotierungsverpflichtungen für Designated Market-Making

Single Stock Futures: Einführung von 72 SSFs aufgrund der Harmonisierung von Kontraktgrößen

Wie im Eurex Clearing-Rundschreiben 098/10 angekündigt, haben die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG die Harmonisierung der Kontraktgrößen für Single Stock Futures (SSFs) beschlossen. Dies erfolgt durch die Einführung von 72 neuen SSFs mit einer neuen Kontraktgröße und Produkt-ISIN sowie einem neuen Produkt-Kürzel jeweils zum 11., 18. und 25. März sowie zum 1. April 2011. 61 der 72 neuen SSFs (85 Prozent) werden eine erhöhte Kontraktgröße haben, so dass Marktteilnehmer von einer Ersparnis der Transaktionsentgelte profitieren.

Die derzeit bestehenden Kontrakte auf dieselben 72 Basiswerte werden schrittweise für den Handel und das Clearing auf „HALT" gesetzt, sofern keine offenen Positionen bestehen. Daher bleiben die bestehenden SSFs für einen gewissen Zeitraum parallel zu den neuen Produkten für Handel und Clearing verfügbar.

Nach der Implementierung der 72 neuen Kontrakte und der Notierungseinstellung der bestehenden Produkte auf dieselben Basiswerte werden die SSFs an Eurex weitgehend vereinheitlichte Kontraktgrößen haben. Diese sind im Einzelnen:

SSFs auf	Kontraktgröße
italienische und britische Aktien	1.000
schweizerische Aktien	100, 10 oder 1
alle anderen Aktien	100

SSFs und Optionen auf dieselben deutschen und schweizerischen Aktien haben eine einheitliche Kontraktgröße.

Mit der Einführung der 72 neuen SSFs werden die Quotierungsverpflichtungen für das Designated Market-Making-Programm in SSFs zum 1. April 2011 angepasst (Anhang 2).

Sie finden in diesem Rundschreiben folgende Informationen:

A. Produktinformationen
B. Schrittweise Einstellung des Handels und des Clearing für die bestehende 72 SSFs auf dieselben Basiswerte
C. Anpassung der Quotierungsverpflichtungen für Designated Market-Making

A. Produktinformationen

1. Kontraktspezifikationen und Übersicht über die neuen Produkte

Die folgende Tabelle enthält eine Übersicht über die wesentlichen Parameter der neuen SSFs. Weitere Bestandteile der Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs wie der letzte Handelstag, die Abwicklung und Ermittlung der täglichen und finalen Abwicklungspreise, Kontraktmonate, Handelszeiten und der Handelskalender entsprechen den bereits bestehenden SSFs mit der gleichen Eurex-Gruppenkennung. Die minimale Preisveränderung für alle neuen SSFs ist 0,0001. Die neuen Kontrakte unterscheiden sich von den bestehenden lediglich in der Kontraktgröße, dem Produktkürzel und der Produkt-ISIN.

Die neuen Produkte und deren wesentliche Parameter sind wie folgt. Bitte beachten Sie: Die Produkte sind zunächst nach der Gruppenkennung und dann alphabetisch nach dem Basiswert sortiert:

Nr.	Futures auf	Basiswert-ISIN	Gruppenkennung	Kassamarktkürzel	Produktwährung	Produktkürzel	Produkt-ISIN	Produktkürzel von Flexible Futures		Kontraktgröße
								Bar	Physisch	
Block 1: Wirksam ab dem 11. März 2011										
1	IMMOFINANZ	AT0000809058	AT01	XVIE	EUR	IMOG	DE000A1KDX09	I4OG	I5OG	100
2	Raiffeisen Bank International	AT0000606306	AT01	XVIE	EUR	RAWG	DE000A1KDXY1	RA4G	RA5G	100
3	Voestalpine	AT0000937503	AT01	XVIE	EUR	VASG	DE000A1KDX17	V4SG	V5SG	100
4	Allianz	DE0008404005	DE01	XETR	EUR	ALVG	DE000A1KDYF8	AL4G	AL5G	100
5	Fraport	DE0005773303	DE01	XETR	EUR	FRAG	DE000A1KDX82	F4AG	F5AG	100
6	Heidelberger Druckmaschinen	DE0007314007	DE01	XETR	EUR	HDDG	DE000A1KDYE1	HD4G	HD5G	100
7	IVG Immobilien	DE0006205701	DE01	XETR	EUR	IVGG	DE000A1KDX90	IV4G	IV5G	100
8	Münchener Rück	DE0008430026	DE01	XETR	EUR	MU2G	DE000A1KDYG6	MU4G	MU5G	100
9	Rheinmetall	DE0007030009	DE01	XETR	EUR	RHMG	DE000A1KDYA9	R4MG	R5MG	100
10	SAP	DE0007164600	DE01	XETR	EUR	SAPH	DE000A1KDYB7	SA4H	SA5H	100
11	Solarworld	DE0005108401	DE01	XETR	EUR	SWVH	DE000A1KDX74	SW4H	SW5H	100
12	Stada Arzneimittel	DE0007251803	DE01	XETR	EUR	SAZG	DE000A1KDYC5	S4ZG	S5ZG	100
13	Südzucker	DE0007297004	DE01	XETR	EUR	SZUG	DE000A1KDYD3	S4UG	S5UG	100
14	Wincor Nixdorf	DE000A0CAYB2	DE01	XETR	EUR	WINH	DE000A1KDYH4	WI4H	WI5H	100
15	Comstar United Telesystems	US47972P2083	RU01	XLON	USD	C8RG	DE000A1KDZU4	C84G	-	100
16	Rosneft	US67812M2070	RU01	XLON	USD	OJSG	DE000A1KDZV2	OJ4G	-	100
17	Severstal	US8181503025	RU01	XLON	USD	RTSG	DE000A1KDZW0	R4SG	-	100
Block 2: Wirksam ab dem 18. März 2011										
18	Actelion	CH0010532478	CH01	XVTX	CHF	ATLH	DE000A1KDZZ3	AT4H	AT5H	100
19	BB Biotech	CH0038389992	CH01	XSWX	CHF	BIOG	DE000A1KDX66	B4OG	B5OG	100
20	Geberit	CH0030170408	CH01	XVTX	CHF	GBRI	DE000A1KDX58	GB4I	GB5I	100
21	Pargesa Holding	CH0021783391	CH01	XSWX	CHF	PARH	DE000A1KDZ49	PA4H	PA5H	100
22	PSP Swiss Property	CH0018294154	CH01	XSWX	CHF	PSPG	DE000A1KDZ31	PS4G	PS5G	100
23	Schindler Holding (PS)	CH0024638196	CH01	XSWX	CHF	SING	DE000A1KDX41	SI44	SI55	100
24	Sika	CH0000587979	CH01	XSWX	CHF	SIKG	DE000A1KDZY6	S4KG	S5KG	1
25	Sonova	CH0012549785	CH01	XSWX	CHF	SONG	DE000A1KDZ15	S4NG	S5NG	100
26	Swiss Life Holding	CH0014852781	CH01	XVTX	CHF	SLHG	DE000A1KDZ23	SL4G	SL5G	100
27	Swiss Re	CH0012332372	CH01	XVTX	CHF	RUKG	DE000A1KDZ07	RU4G	RU5G	100
28	Synthes	US87162M4096	CH01	XVTX	CHF	SYSG	DE000A1KDZX8	S4SG	S5SG	100
29	Cargotec	FI0009013429	FI01	XHEL	EUR	C1CG	DE000A1KDYN2	C4CG	C5CG	100
30	Kesko	FI0009000202	FI01	XHEL	EUR	KEKG	DE000A1KDYK8	KE4G	KE5G	100
31	Metso	FI0009007835	FI01	XHEL	EUR	VLMH	DE000A1KDYM4	VL4H	VL5H	100
32	Rautaruukki	FI0009003552	FI01	XHEL	EUR	RKKH	DE000A1KDYL6	RK4H	RK5H	100
33	TeliaSonera	SE0000667925	FI01	XHEL	EUR	TLSG	DE000A1KDZT6	TL4G	TL5G	100
Block 3: Wirksam ab dem 25. März 2011										
34	Colruyt	BE0974256852	BE01	XBRU	EUR	EFCG	DE000A1KDX33	EF4G	EF5G	100
35	KBC Groep	BE0003565737	BE01	XBRU	EUR	KDBG	DE000A1KDX25	KD4G	KD5G	100
36	C&C Group	IE00B010DT83	IE01	XDUB	EUR	GCCG	DE000A1KDY24	GC4G	-	100
37	Independent News & Media	IE00B59HWB19	IE01	XDUB	EUR	IPDG	DE000A1KDY40	IP4G	-	100
38	Irish Life & Permanent Group	IE00B59NXW72	IE01	XDUB	EUR	ILBG	DE000A1KDY57	IL4G	-	100
39	Kerry Group	IE0004906560	IE01	XDUB	EUR	KYGG	DE000A1KDY16	KY4G	-	100
40	Assicurazioni Generali	IT0000062072	IT01	XMIL	EUR	ASGG	DE000A1KDY65	A4GG	A5GG	1000
41	Autogrill	IT0001137345	IT01	XMIL	EUR	AULG	DE000A1KDZA6	AU4G	AU5G	1000

Nr.	Futures auf	Basiswert-ISIN	Gruppenkennung	Kassamarktkürzel	Produktwährung	Produktkürzel	Produkt-ISIN	Produktkürzel von Flexible Futures		Kontraktgröße
								Bar	Physisch	
42	Banca Carige	IT0003211601	IT01	XMIL	EUR	BCAG	DE000A1KDZH1	B4AG	B5AG	1000
43	Cattolica di Assicurazioni	IT0000784154	IT01	XMIL	EUR	CASH	DE000A1KDY81	CA4H	CA5H	1000
44	Eni	IT0003132476	IT01	XMIL	EUR	ENTG	DE000A1KDZG3	E4TG	E5TG	1000
45	EXOR	IT0001353140	IT01	XMIL	EUR	IILG	DE000A1KDZC2	II4G	II5G	1000
46	Fondiaria-Sai	IT0001463071	IT01	XMIL	EUR	SOAH	DE000A1KDZD0	SO4H	SO5H	1000
47	Italcementi	IT0001465159	IT01	XMIL	EUR	ITAH	DE000A1KDZE8	IT4H	IT5H	1000
48	Lottomatica	IT0003990402	IT01	XMIL	EUR	N4GG	DE000A1KDZJ7	N44G	N45G	1000
49	Luxottica Group	IT0001479374	IT01	XMIL	EUR	LUXG	DE000A1KDZF5	LU4G	LU5G	1000
50	Mediolanum	IT0001279501	IT01	XMIL	EUR	MUNG	DE000A1KDZB4	M4NG	M5NG	1000
51	Saipem	IT0000068525	IT01	XMIL	EUR	SPEH	DE000A1KDY73	SP4H	SP5H	1000
52	Tenaris	LU0156801721	IT01	XMIL	EUR	TENG	DE000A1KDZK5	TE4G	-	1000
53	Unipol Gruppo Finanziario Azioni Priv.	IT0001074589	IT01	XMIL	EUR	UNFG	DE000A1KDY99	UN4G	-	1000
Block 4: Wirksam ab dem 1. April 2011										
54	Eiffage	FR0000130452	FR01	XPAR	EUR	EF3G	DE000A1KDYV5	E43G	E53G	100
55	Hermes International	FR0000052292	FR01	XPAR	EUR	HMIG	DE000A1KDYP7	H4IG	H5IG	100
56	Imerys	FR0000120859	FR01	XPAR	EUR	NKFG	DE000A1KDYS1	NK4G	NK5G	100
57	JCDecaux	FR0000077919	FR01	XPAR	EUR	DCSG	DE000A1KDYQ5	DC4G	DC5G	100
58	Neopost	FR0000120560	FR01	XPAR	EUR	NP6G	DE000A1KDYR3	NP4G	NP5G	100
59	SCOR	FR0010411983	FR01	XPAR	EUR	SCOI	DE000A1KDYX1	SC4I	SC5I	100
60	Technip	FR0000131708	FR01	XPAR	EUR	THPG	DE000A1KDYW3	TH4G	TH5G	100
61	WENDEL Investissement	FR0000121204	FR01	XPAR	EUR	MFXG	DE000A1KDYT9	MF4G	MF5G	100
62	Zodiac Aerospace	FR0000125684	FR01	XPAR	EUR	ZDCG	DE000A1KDYU7	Z4CG	Z5CG	100
63	Bank of Greece	GRS004013009	GR01	XATH	EUR	BGCG	DE000A1KDYY9	B4CG	-	100
64	EFG Eurobank Ergasias	GRS323013003	GR01	XATH	EUR	EFGG	DE000A1KDY08	E4GG	-	100
65	Titan Cement	GRS074083007	GR01	XATH	EUR	TICG	DE000A1KDYZ6	TI4G	-	100
66	Corio	NL0000288967	NL01	XAMS	EUR	CL6G	DE000A1KDZL3	CL4G	CL5G	100
67	CSM	NL0000852549	NL01	XAMS	EUR	CSMG	DE000A1KDZP4	C4MG	C5MG	100
68	Randstad Holding	NL0000379121	NL01	XAMS	EUR	RSHG	DE000A1KDZN9	RS4G	RS5G	100
69	Wereldhave	NL0000289213	NL01	XAMS	EUR	WERG	DE000A1KDZM1	WE4G	WE5G	100
70	Banco BPI	PTBPI0AM0004	PT01	XLIS	EUR	BPIG	DE000A1KDZR0	B4IG	-	100
71	Banco Comercial Português	PTBCP0AM0007	PT01	XLIS	EUR	BCPG	DE000A1KDZQ2	BC4G	-	100
72	CIMPOR Cimentos de Portugal	PTCPR0AM0003	PT01	XLIS	EUR	CPVG	DE000A1KDZS8	CP44	-	100

2. Zulassung zum OTC-Block-Trading

Die neuen SSFs werden zum OTC-Block-Trading mit einer minimalen Block Trade-Größe von einem Kontrakt zugelassen.

3. Cross Margining und Riskoparameter

Nach dem Aufsetzen im Eurex®-System werden die entsprechenden Risk-Parameter als „Theoretical Price Files“ versandt.

Ab dem Handelsstart werden die Parameter auch auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

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

Zur direkten Weiterleitung klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/clearing/risk/parameters_de.html

4. Mistrade-Parameter

Die Mistrade Ranges für die neuen Produkte werden ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

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

Zur direkten Weiterleitung klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/EQU/FUT/products_de.html

5. Transaktionslimite

Die Transaktionslimite, die derzeit für bestehende SSFs mit dem entsprechenden Eurex-Gruppenkürzel gelten, werden analog auf die neuen SSFs angewendet. Detaillierte Informationen wurden auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

Zur direkten Weiterleitung klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/technology/transaction_limits_de.html

6. Transaktionsentgelte

Für die neuen SSFs gelten die ab dem 1. Februar 2011 wirksamen Transaktionsentgelte für SSFs mit der jeweiligen Gruppenkennung (siehe Eurex Clearing-Rundschreiben 004/11, Anhang 1).

7. Vendorenkürzel

Ab Handelsstart finden Sie die Vendorenkürzel für die neuen Instrumente auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

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

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

Zur direkten Weiterleitung klicken Sie auf folgenden Link:
http://www.eurexchange.com/trading/products/vendor_product_code_search_de.html

8. Positionslimite

Die Positionslimite werden auf der Eurex-Website publiziert unter dem Pfad:

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

Zur direkten Weiterleitung klicken Sie auf folgenden Link:

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

B. Schrittweise Einstellung des Handels und des Clearing für die 72 bestehenden SSFs

Für die 72 derzeit bestehenden SSFs mit einem anderen Produktkürzel, einer anderen Produkt-ISIN und Kontraktgröße auf den gleichen Basiswert wird nach der jeweiligen Tagesendverarbeitung am 11., 18., 25. März sowie am 1. April 2011 Folgendes durchgeführt:

1) Der Handel in den entsprechenden bestehenden Kontrakten wird auf „HALT" gesetzt, sofern keine offenen Positionen vorhanden sind.

2) Der Handel in den entsprechenden Kontraktmonaten eines bestehenden SSF ohne offene Positionen wird auf „inactive" gesetzt, wodurch alle bestehenden Kontraktmonate ohne offene Positionen vom Handel ausgesetzt werden.

3) Es werden keine weiteren Kontraktmonate in den bestehenden Kontrakten eingeführt.

4) Die Notierung der bestehenden Kontrakte wird zeitnah eingestellt. Details dazu werden in einem weiteren Rundschreiben veröffentlicht.

C. Anpassung der Quotierungsverpflichtungen für Designated Market-Making

Neun der neuen 72 SSFs werden zum 1. April 2011 in das bestehende Designated Market-Making-Programm für SSFs aufgenommen und ergänzen damit die jeweils bestehenden SSFs auf den betroffenen Basiswert in den Paketen. Die Quotierungsverpflichtungen wie die Anzahl der zu quotierenden SSFs im jeweiligen Paket und die monatlichen Ausnahmen für die Quotierung werden dementsprechend geändert. Darüber hinaus wird die Minimum Quote Size für die neun neuen SSFs analog derer für die bestehenden SSFs auf denselben Basiswert angepasst. Die detaillierten Verpflichtungen sind Anhang 2 zu entnehmen.

Wenn Sie an der Teilnahme an dem Designated Market-Making-Programm interessiert sind, füllen Sie bitte die „Application Form - Designated Market-Making Scheme" (Eurex-Rundschreiben 174/10, Anhang 2) aus und senden Sie diese an Dr. Weiwei Wang, Faxnummer +49-69-211-1 44 61. Market Maker, die den Vertrag bereits für die bestehenden SSFs unterzeichnet haben, müssen keinen neuen Antrag stellen, sollten jedoch die in Anhang 2 angepassten Verpflichtungen des Programms aufgrund der Einführung der neuen SSFs zur Kenntnis nehmen.

Frankfurt, 16. Februar 2011

****

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 **
[…]						
Allianz SE	ALVG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	FRAG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Heidelberger Druckmaschinen AG	HDDG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Immofinanz AG	IMOG	AT01	XVIE	100	0,0001	EUR
IVG Immobilien AG	IVGG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
JSC COMSTAR - Obyedinenniye Telesistemy	C8RG	RU01	XLON	100	0,0001	USD
JSC SeverStal	RTSG	RU01	XLON	100	0,0001	USD
Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG	MU2G	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Neftyanaya Kompaniya Rosneft	OJSG	RU01	XLON	100	0,0001	USD
Raiffeisen International Bank-Holding AG	RAWG	AT01	XVIE	100	0,0001	EUR
Rheinmetall AG	RHMG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
SAP AG	SAPH	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
SolarWorld AG	SWVH	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
STADA Arzneimittel AG	SAZG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
Südzucker AG	SZUG	DE01	XETR	100	0,0001	EUR
voestalpine AG	VASG	AT01	XVIE	100	0,0001	EUR
Wincor Nixdorf AG	WINH	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

[…]

****

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 **
[…]						
Actelion Ltd. - N.	ATLH	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
BB Biotech AG	BIOG	CH01	XSWX	100	0,0001	CHF
Cargotec Corp.	C1CG	FI01	XHEL	100	0,0001	EUR
Geberit AG - N.	GBRI	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
Kesko Oy	KEKG	FI01	XHEL	100	0,0001	EUR
Metso Corp.	VLMH	FI01	XHEL	100	0,0001	EUR
Pargesa Holding S.A.	PARH	CH01	XSWX	100	0,0001	CHF
PSP Swiss Property AG - N.	PSPG	CH01	XSWX	100	0,0001	CHF
Rautaruukki Ojy	RKKH	FI01	XHEL	100	0,0001	EUR
Schindler Holding AG	SING	CH01	XSWX	100	0,0001	CHF
Schweizerische Rückversicherungs-Gesellschaft AG - N.	RUKG	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
Sika AG	SIKG	CH01	XSWX	1	0,0001	CHF
Sonova Holding AG - N.	SONG	CH01	XSWX	100	0,0001	CHF
Swiss Life Holding AG - N.	SLHG	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
Synthes Inc.	SYSG	CH01	XVTX	100	0,0001	CHF
TeliaSonera AB	TLSG	FI01	XHEL	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

[…]

****

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 **
[...]						
Assicurazioni Generali S.p.A.	ASGG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Autogrill S.p.A.	AULG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Banca Carige S.p.A.	BCAG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
C&C Group PLC	GCCG	IE01	XDUB	100	0,0001	EUR
Eni S.p.A.	ENTG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Établissements Franz Colruyt S.A.	EFCG	BE01	XBRU	100	0,0001	EUR
Exor S.p.A.	IILG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Fondiaria - S.A.I S.p.A.	SOAH	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Independent News and Media PLC	IPDG	IE01	XDUB	100	0,0001	EUR
Irish Life & Permanent PLC	ILBG	IE01	XDUB	100	0,0001	EUR
Italcementi S.p.A.	ITAH	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
KBC Groep N.V.	KDBG	BE01	XBRU	100	0,0001	EUR
Kerry Group PLC	KYGG	IE01	XDUB	100	0,0001	EUR
Lottomatica S.p.A.	N4GG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Luxottica Group S.p.A.	LUXG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Mediolanum S.p.A.	MUNG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Saipem S.p.A.	SPEH	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Società Cattolica di Assicurazioni S.p.A.	CASH	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Tenaris S.A.	TENG	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
Unipol Gruppo Finanziario S.p.A. Azioni Priv.	UNFG	IT01	XMIL	1000	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

[…]

****

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 BPI S.A.	BPIG	PT01	XLIS	100	0,0001	EUR
Banco Comercial Português S.A.	BCPG	PT01	XLIS	100	0,0001	EUR
Bank of Greece S.A.	BGCG	GR01	XATH	100	0,0001	EUR
Cimpor - Cimentos de Portugal S.G.P.S. S.A.	CPVG	PT01	XLIS	100	0,0001	EUR
Corio N.V.	CL6G	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
CSM N.V.	CSMG	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
EFG Eurobank Ergasias S.A.	EFGG	GR01	XATH	100	0,0001	EUR
Eiffage S.A.	EF3G	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Hermes International S.A.	HMIG	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
IMERYS S.A.	NKFG	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
JCDecaux S.A.	DCSG	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Neopost S.A.	NP6G	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Randstad Holding N.V.	RSHG	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
SCOR SE	SCOI	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Technip S.A.	THPG	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Titan Cement Co. S.A.	TICG	GR01	XATH	100	0,0001	EUR
Wendel S.A.	MFXG	FR01	XPAR	100	0,0001	EUR
Wereldhave N.V.	WERG	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR
Zodiac S.A.	ZDCG	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

[…]

Single Stock Futures: Quotierungsverpflichtungen für Designated Market-Making

1. Designated Market-Making-Entgelte:

Falls unten stehende Quotierungsverpflichtungen auf Monatsbasis erfüllt werden, erstattet Eurex Clearing einen Teil der Transaktionsentgelte für die Geschäfte in allen SSFs im jeweiligen Paket zurück, die von DMMs aus dem M-Konto heraus getätigt wurden. Die Rückerstattung der Transaktionsentgelte beträgt jeweils 80 Prozent für Geschäfte im elektronischen Orderbuch und 50 Prozent für Geschäfte im OTC Block-Trading.

2. Quotierungsverpflichtungen:

- Designated Market Maker verpflichten sich, eine bestimmte Anzahl von Single Stock Futures im jeweiligen Paket (Punkt 2.1) permanent zu quotieren. Dabei wird eine Mindestanzahl von Kontrakten (Punkt 2.3) mit einer maximalen Geld-Brief-Spanne (Maximum Spreads) (Punkt 2.2) quotiert.
- Die Quotierungsdauer beträgt mindestens 80 Prozent der täglichen Handelszeit zwischen 09:00 Uhr und 17:30 Uhr (MEZ) im Monatsdurchschnitt.
- Die zu quotierenden Verfallmonate sind jeweils der nächste Verfall und der erste darauf folgende Quartalsverfall.

2.1 Quotierungspakete und Anzahl der Ausnahmen

Fünf Quotierungspakete werden für Designated Market-Making angeboten. Die Quotierungsverpflichtungen für ein Paket gelten als erfüllt, wenn bei den enthaltenen Produkten die Verpflichtungen erfüllt sind, wobei bei jedem Paket eine bestimmte Anzahl von Ausnahmen pro Monat erlaubt ist. Eurex behält sich vor, zu einem späteren Zeitpunkt die Ausnahmen zu reduzieren.

Paket	Paket-Kennzeichnung	Beinhaltete Eurex-Produkte	Anzahl der Paketkomponenten	Anzahl der monatlichen Ausnahmen
EURO STOXX 50®	**ESX50**	Alle SSFs auf Komponenten des EURO STOXX 50®	55 ~~50~~	12 ~~10~~
German	**DE**	Alle SSFs auf Komponenten des DAX® 30	33 ~~30~~	6
French	**FR**	Alle SSFs auf Komponenten des CAC 40	41 ~~40~~	12 ~~11~~
Swiss	**CH**	Alle SSFs auf Komponenten des SMI® - Index	23 ~~20~~	5 ~~4~~
EURO STOXX 50®/ German/French	**ESX50/DE/FR**	Alle SSFs auf Komponenten des EURO STOXX 50®, des DAX® 30 und des CAC 40	93 ~~87~~	36 ~~34~~

2.2 Spread-Klassen

Spread-Klasse	Geldkurse bis (EUR/CHF)	Maximum Spreads (EUR/CHF)	
		Erster Verfallmonat	Erster Quartalsverfallmonat
1	≤ 40,00	0,08	0,12
	> 40,00	0,2%	0,3%
2	≤ 40,00	0,12	0,16
	> 40,00	0,3%	0,4%

2.3 Liste der Mindestquotierungsgröße und Spread-Klassen-Zuordnung

Nr.	SSFs auf*	Produkt-Kürzel	Mindestquotierungs-größe in Kontrakten	Spread-Klasse	Package-Kürzel
SSFs in EUR					
1	Accor	ACRH	5	2	FR; ESX50/DE/FR
2	Adidas	ADSG	5	2	DE; ESX50/DE/FR
3	Air Liquide	AIRI	10	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
4	Alcatel-Lucent	CGEF	50	2	FR; ESX50/DE/FR
5	Allianz	ALVF (10)	100	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
6		ALVG (100)	10		
7	ALSTOM	AOMG	5	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
8	Anheuser-Busch-InBev	ITKG	5	1	ESX50; ESX50/DE/FR
9	Arcelor Mittal	ISPF	15	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
10	Assicurazioni Generali	ASGF (100)	10	2	ESX50; ESX50/DE/FR
11		ASGG (1000)	2		
12	AXA	AXAG	25	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
13	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	BBVGF	25	1	ESX50; ESX50/DE/FR
14	Banco Santander	SANG	25	1	ESX50; ESX50/DE/FR
15	BASF	BASG	25	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
16	Bayer	BAYF	25	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
17	Beiersdorf	BEIG	10	2	DE; ESX50/DE/FR
18	BMW	BMWF	10	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
19	BNP Paribas	BNPH	10	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
20	Bouygues	BYGF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
21	Capgemini	CGMF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
22	Carrefour	CARF	15	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
23	Commerzbank	CBKF	50	2	DE; ESX50/DE/FR
24	Crédit Agricole	XCAH	25	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
25	CRH	CRGG	10	2	ESX50; ESX50/DE/FR
26	Daimler	DAIF	25	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
27	Danone	BSNH	10	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
28	Deutsche Bank	DBKGF	25	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
29	Deutsche Börse	DB1G	10	2	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
30	Deutsche Post	DPWF	25	1	DE; ESX50/DE/FR
31	Deutsche Telekom	DTEF	50	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
32	E.ON	EOAH	25	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
33	EADS	EADF	10	2	FR; ESX50/DE/FR
34	Electricité de France	E2FF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
35	Enel	ENLG	5	1	ESX50; ESX50/DE/FR
36	Eni	ENTF (500)	10	1	ESX50; ESX50/DE/FR
37		ENTG (1000)	5		
38	Essilor International	EFXF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
39	France Télécom	FTEF	50	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
40	Fresenius Medical Care	FMEH	5	2	DE; ESX50/DE/FR
41	Fresenius pref.	FREG	5	2	DE; ESX50/DE/FR
42	GDF Suez	GZFG	10	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR

Nr.	SSFs auf*	Produkt-Kürzel	Mindestquotierungs-größe in Kontrakten	Spread-Klasse	Package-Kürzel
43	HeidelbergCement	HEFG	5	2	DE; ESX50/DE/FR
44	Henkel pref.	HENG	5	2	DE; ESX50/DE/FR
45	Iberdrola	IBEG	25	1	ESX50; ESX50/DE/FR
46	Infineon	IFXG	50	2	DE; ESX50/DE/FR
47	ING	INNG	50	1	ESX50; ESX50/DE/FR
48	Intesa Sanpaolo	IESH	10	1	ESX50; ESX50/DE/FR
49	K+S	SDXH	5	2	DE; ESX50/DE/FR
50	Lafarge	CILF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
51	Linde	LING	5	1	DE; ESX50/DE/FR
52	L'Oréal	LORF	10	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
53	Lufthansa	LHAF	25	2	DE; ESX50/DE/FR
54	LVMH	MOHF	10	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
55	MAN	MANG	5	2	DE; ESX50/DE/FR
56	Merck	MRKG	5	2	DE; ESX50/DE/FR
57	Metro	MEOF	5	1	DE; ESX50/DE/FR
58	Michelin	MLXF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
59	Münchener Rück	MU2F (10)	100	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
60		MU2G (100)	10		
61	Natixis	KNFH	5	2	FR; ESX50/DE/FR
62	Nokia	NO3F	100	1	ESX50; ESX50/DE/FR
63	Pernod-Ricard	PERH	5	2	FR; ESX50/DE/FR
64	Peugeot	PEUF	10	2	FR; ESX50/DE/FR
65	Philips	PH1F	25	1	ESX50; ESX50/DE/FR
66	PPR	PPXF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
67	Publicis Groupe	PU4F	5	2	FR; ESX50/DE/FR
68	Renault	RNLF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
69	Repsol YPF	REPF	10	1	ESX50; ESX50/DE/FR
70	RWE	RWEF	25	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
71	Saint-Gobain	GOBG	15	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
72	Sanofi-Aventis	SNWF	10	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
73	SAP	SAPG (50)	50	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
74		SAPH (100)	25		
75	Schneider Electric	SNDG	10	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
76	Siemens	SIEF	25	1	DE; ESX50; ESX50/DE/FR
77	Société Générale	SGEI	10	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
78	STMicroelectronics	SGMF	10	2	FR; ESX50/DE/FR
79	Technip	THPF (50)	5	2	FR; ESX50/DE/FR
80		THPG (100)	2		
81	Telecom Italia	TQIF	25	2	ESX50; ESX50/DE/FR
82	Telefónica	TEFF	25	1	ESX50; ESX50/DE/FR
83	ThyssenKrupp	TKAG	10	1	DE; ESX50/DE/FR
84	TOTAL	TOTG	15	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
85	Unibail-Rodamco	UBLF	5	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
86	UniCredit	CR5H	10	1	ESX50; ESX50/DE/FR
87	Unilever NV	UNIH	25	1	ESX50; ESX50/DE/FR
88	Vallourec	VACH	5	2	FR; ESX50/DE/FR
89	Veolia Environnement	VVDG	5	2	FR; ESX50/DE/FR

Nr.	SSFs auf*	Produkt-Kürzel	Mindestquotierungs-größe in Kontrakten	Spread-Klasse	Package-Kürzel
90	Vinci	SQUG	10	2	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
91	Vivendi Universal	VVUF	25	1	FR; ESX50; ESX50/DE/FR
92	VW pref.	VO3G	10	2	DE; ESX50/DE/FR
93	Suez Environnement	SEVF	5	2	FR; ESX50/DE/FR
SSFs in CHF					
1	ABB	ABBF	25	1	CH
2	Actelion	ATLG (50)	10	2	CH
3		ATLH (100)	5		
4	Adecco	ADEF	5	2	CH
5	Cie Financière Richemont	CFRI	10	2	CH
6	Credit Suisse Group	CSGG	25	1	CH
7	Holcim	HOLH	5	2	CH
8	Julius Bär Gruppe	BAEH	5	2	CH
9	Lonza Group	LONF	5	2	CH
10	Nestlé	NESG	50	1	CH
11	Novartis	NOVF	25	1	CH
12	Roche Holding	ROGF	5	1	CH
13	SGS	SGSI	5	2	CH
14	Swatch Group (bearer shares)	UHFF	10	2	CH
15	Swiss Re	RUKF (10)	100	1	CH
16		RUKG (100)	10		
17	Swisscom	SCMH	10	2	CH
18	Syngenta	SYNG	10	2	CH
19	Synthes	SYSF (10)	10	2	CH
20		SYSG (100)	2		
23	Transocean	RIGF	5	2	CH
24	UBS	UBSH	50	1	CH
25	Zurich Financial Services	ZURF	50	1	CH

Falls infolge einer Kapitalmaßnahme in einem der Basiswerte ein Folgeprodukt mit einer Standardkontraktgröße zum Handel zugelassen wird, wird dieses Folgeprodukt ab dem nächsten Kalendermonat nach dem ersten Handelstag in die Quotierungsverpflichtungen aufgenommen. Dasselbe gilt für den Fall einer Komponenten-änderung des jeweiligen Index.

* Die Zahl in Klammern hinter dem Basiswert zeigt die Kontraktgröße des jeweiligen bereits bestehenden und neuen SSF.