



eurex rundschreiben 215/15

Datum: 9. Dezember 2015
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Mehtap Dinc

 **Aktion erforderlich**

Aktioptionen: Einführung von Optionen auf ABN AMRO Group

Kontakt: Derivatives Trading Operations, T +49-69-211-1 12 10, Lorena Dishnica, T +44-207-8 62-72 42

Zielgruppe:

➡ Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderter Annex B der Kontraktsspezifikationen 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 **14. Dezember 2015** den folgenden Beschluss gefasst:

- Einführung von Optionen auf ABN AMRO Group (AAR) gemäß Annex B aus dem Anhang

Dieses Rundschreiben enthält alle Informationen zur Einführung des neuen Produkts sowie die geänderten Abschnitte der relevanten Regelwerke der Eurex Deutschland und Eurex Zürich AG.



Aktioptionen: Einführung von Optionen auf ABN AMRO Group

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben die Einführung von Aktioptionen auf ABN AMRO Group mit Wirkung zum 14. Dezember 2015 beschlossen.

1. Kontraktsspezifikationen und Produktparameter

Option auf	Produkt-ISIN/ISIN des Basiswerts	Eurex Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Maximale Laufzeit in Monaten	Minimale Preisver-änderung	Währung
Einführung zum 14. Dezember 2015						
<i>Niederländische Aktioptionen (Gruppenkennung: NL11)</i>						
ABN AMRO GROUP	NL0011540547	AAR	100	60	0,01	EUR

2. Laufzeiten

Die Aktioptionen sind bis zu 60 Monate handelbar, d. h. bis einschließlich der drei nächsten aufeinander folgenden Kalendermonate und einschließlich der nächsten drei darauf folgenden Quartalsmonate aus dem Zyklus März, Juni, September und Dezember sowie vier der darauf folgenden Halbjahresverfalltermine aus dem Zyklus Juni und Dezember sowie die zwei darauf folgenden Jahresmonate aus dem Zyklus Dezember.

3. Ausübungspreise

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

Bei Einführung der Aktioptionskontrakte stehen für jeden Call und Put für jedes Verfalldatum in den jeweiligen Laufzeiten mindestens sieben Ausübungspreise für den Handel zur Verfügung. Drei hiervon sind im Geld, einer am Geld und drei aus dem Geld.

Die Kontraktsspezifikationen für die neuen Produkte stehen auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktioptionen

4. Risikoparameter

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

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Ein gesondertes Eurex-Rundschreiben ist dafür nicht vorgesehen.

5. Handelszeiten

Die Handelszeiten entsprechen den jeweils gültigen Handelszeiten für die vorhandene Eurex-Gruppenkennung und sind den Kontraktsspezifikationen zu entnehmen.

6. Mistrade Ranges, Positionslimite

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

Produkte > Aktienderivate > Aktioptionen

7. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel für die neuen Produkte entnehmen Sie bitte ab Handelsstart der Eurex-Website unter dem Link:

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

8. Handelskalender

Es gelten die bestehenden Handelskalender für niederländische Aktienoptionen. Diese finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Handel > Handelskalender

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

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

10. Produktgruppe

Die neuen Aktienoptionen werden der folgenden Produktgruppe zugeordnet:

Produktgruppe	Abwicklungs- Inkationseinheit	Regulatorischer Status	Abwicklungsart	Produktart	Produktsegment	Produktwährung	Produktkürzel					
							E	N	S	O	E	E
Niederländische Aktienoptionen	E X S	N	C/P (S)	O	Aktien- optionen	EUR	E	N	S	O	E	E

Informationen zur Zuordnung von Produkten und Produktgruppen entnehmen Sie bitte Eurex-Rundschreiben 232/07, Abschnitt 1.6.

11. Eurex Trade Entry Services

Die Mindestanzahl zu handelnder Kontrakte mittels der Eurex Block Trade- und Flexible Options Services beträgt 250 Kontrakte.

Das untertägige Nichtanzeige-Limit („intra-day non-disclosure limit“) für Eurex Block Trades entspricht 5.001 Kontrakten.

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

12. Prisma-Fähigkeit

Derzeit sind alle zum Handel zugelassenen Derivate auf Aktien, Aktienindizes, Fixed Income- und Geldmarktinstrumente sowie alle OTC IRS-Produkte für die Berechnung in Prisma zugelassen.

Details zu bestimmten Prisma-fähigen Eurex-Produkten sind in der aktuellen Liste enthalten, die unter dem folgenden Link auf der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com zur Verfügung steht:

Risikomanagement > Risikoparameter

oder rufen Sie die Risk Control-Hotline +49-69-211-1 24 52 bei Fragen zur Prisma-Fähigkeit an.

9. Dezember 2015

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte
und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland
und der Eurex Zürich**

ÄNDERUNGEN SIND WIE FOLGT KENNTLICH GEMACHT:

ERGÄNZUNGEN SIND UNTERSTRICHEN

LÖSCHUNGEN SIND DURCHGESTRICHEN

[...]

Annex B zu Ziffer 2.6 der Kontraktsspezifikationen:

Optionen auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppenkennung*	Kassamarkt-ID*	Kontraktgröße	Maximale Laufzeit (Monate)	Minimale Preisveränderung	Währung**
[...]							
<u>ABN AMRO Group</u>	<u>AAR</u>	<u>NL11</u>	<u>XAMS</u>	<u>100</u>	<u>60</u>	<u>0.01</u>	<u>EUR</u>
[...]							

[...]
