X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 020/10*

Datum: Frankfurt, 4. Februar 2010
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

⚠ **Aktion erforderlich** ⚠ **Hohe Priorität**

Spanische Single Stock Futures: Einführung harmonisierter Kontraktgrößen; Acht spanische Single Stock Futures und zwei belgische Aktienoptionen: Zulassungswiderruf

Kontakt: Alexey Weizmann (Eurex Product Strategy), Tel. +44 20-78 62 72 13,
E-Mail: alexey.weizmann@eurexchange.com

Zielgruppe:

Ü Alle Abteilungen

Anhänge:

Geänderte Abschnitte der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Zum **15. Februar 2010** wird Eurex größtenteils die Kontraktgrößen bei spanischen Single Stock Futures bei 100 Aktien pro Future harmonisieren. Die minimale Preisveränderung wird überwiegend bei 0,0001 harmonisiert.

Die Zulassungen für acht spanische Single Stock Futures und zwei belgische Aktienoptionen werden zum **15. Februar 2010** widerrufen.

Spanische Single Stock Futures: Einführung harmonisierter Kontraktgrößen; Acht spanische Single Stock Futures und zwei belgische Aktienoptionen: Zulassungswiderruf

Um den Handel in spanischen Single Stock Futures zu erleichtern, wird Eurex größtenteils die Kontraktgrößen bei spanischen Single Stock Futures bei 100 Aktien pro Future harmonisieren (die Kontraktgrößen werden bei allen SSFs erhöht). Die minimale Preisveränderung wird überwiegend bei 0,0001 harmonisiert (die Anzahl der Dezimalstellen erhöht sich von 3 auf 4). So führt Eurex sieben neue Kontrakte mit der Kontraktgröße 100 und einen Kontrakt mit der Kontraktgröße 1.000 (Futures auf Iberia Líneas Aéreas de España S.A., Produktkürzel: IBLG) ein. Eurex harmonisiert auch die minimalen Preisveränderungen bei 0,0001. Die minimale Preisveränderung für Futures auf Acciona S.A. (Produktkürzel: ANAG) bleibt bei 0,001.

Die alten Kontrakte werden am 15. Februar 2010 auf HALT gesetzt und aus dem Handel genommen, sobald keine offenen Positionen mehr vorhanden sind.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Futures auf	Basiswert-ISIN	Produkt-ISIN	Produkt-kürzel Flexible Cash Futures	Kon-trakt-größe	Minimale Preisverän-derung
ANAG	Acciona S.A.	ES0125220311	DE000A1CRKF4	AN4G	100	0,001
OCIG	ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.	ES0167050915	DE000A1CRKG2	OC4G	100	0,0001
BPQG	Banco Pastor S.A.	ES0113770434	DE000A1CRKH0	BPQ4	100	0,0001
CPSG	Compañía Española de Petróleos S.A.	ES0132580319	DE000A1CRKJ6	CP4G	100	0,0001
CSVG	Corporación Financiera Alba S.A.	ES0117160111	DE000A1CRKK4	C4VG	100	0,0001
FCCG	Fomento de Construcciones y Contratas S.A.	ES0122060314	DE000A1CRKL2	FCC4	100	0,0001
IBLG	Iberia Líneas Aéreas de España S.A.	ES0147200036	DE000A1CRKM0	I4LG	1000	0,0001
RE2G	Red Eléctrica Corporación S.A.	ES0173093115	DE000A1CRKN8	RE4G	100	0,0001

Für alle neuen Futures gilt:

- Die Produktwährung ist EUR
- Die Gruppenkennung ist ES01
- die Mindestgröße für Block Trades wird 1 sein
- die Produktgruppe ist XNCFSE.

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Single Stock Futures identisch mit denen für die bereits bestehenden Single Stock Futures mit derselben Gruppenkennung; dies trifft auch auf den letzten Handelstag, die Erfüllung sowie die Ermittlung des täglichen Abrechnungspreises und des Schlussabrechnungspreises, die Handelszeiten und den Handelskalender zu.

Der aktualisierte Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich wird zum Produkteinführungsdatum auf der Eurex-Website unter dem folgenden Pfad veröffentlicht:

www.eurexchange.com > Dokumente > Regelwerke

3. Risikoparameter

Die gültigen Risikoparameter werden nach deren Aufsetzen im Eurex®-System per „Theoretical Price Files“ übertragen. Mit Handelsstart werden die Parameter auch unter dem folgenden Pfad auf der Eurex-Website veröffentlicht:

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

4. Mistrade-Parameter

Mistrade Ranges stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem Pfad für SSFs zur Verfügung:

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

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs mit derselben Gruppenkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte sind analog zu den entsprechenden bestehenden SSFs.

7. Vendorenkürzel

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

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

Folgende SSFs werden zum 15. Februar 2010 auf HALT gesetzt und aus dem Handel genommen, sobald keine offenen Positionen mehr vorhanden sind.

Futures auf Aktien der	Produkt-kürzel	Gruppen-kennung**	Kassa-markt-ID**	Kontrakt-größe	Minimale Preisverän-derung*	Währung
Acciona S.A.	ANAF	ES01	XMAD	10	0,001	EUR
ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A.	OCIF	ES01	XMAD	50	0,001	EUR
Banco Pastor S.A.	BPQF	ES01	XMAD	50	0,001	EUR
Compañía Española de Petróleos S.A.	CPSF	ES01	XMAD	50	0,001	EUR
Corporación Financiera Alba S.A.	CSVF	ES01	XMAD	50	0,001	EUR
Fomento de Construcciones y Contratas S.A.	FCCF	ES01	XMAD	50	0,001	EUR
Iberia Líneas Aéreas de España S.A.	IBLF	ES01	XMAD	500	0,0001	EUR
Red Eléctrica Corporación S.A.	RE2F	ES01	XMAD	50	0,001	EUR

* Die minimale Preisveränderung bezieht sich bei Aktien-Futures mit zugewiesener Gruppenkennung GB01 auf Pence.

** Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID dienen unter anderem der Festlegung eines Handelsplatzes für den Preis der dem Kontrakt zugrunde liegenden Aktie.

Folgende Optionen sind schon auf HALT und werden zum 15. Februar 2010 aus dem Handel genommen.

Optionen auf Aktien der	Produkt-kürzel	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Maximale Laufzeit (Monate)	Minimale Preisverän-derung	Währung
Sofina S.A.	SOF	BE12	XBRU	100	24	0,01	EUR
Ackermans & van Haaren N.V.	B3K	BE12	XBRU	100	24	0,01	EUR

* Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID dienen unter anderem der Festlegung eines Handelsplatzes für den Preis der dem Kontrakt zugrunde liegenden Aktie.

Frankfurt, 4. Februar 2010

****

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 Preisverän-derung**	Währung
[…]						
Acciona S.A.	ANAG	ES01	XMAD	100	0,001	EUR
ACS. Actividades de Construcción y Servicios S.A.	OCIG	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Banco Pastor S.A.	BPQG	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Compañía Española de Petróleos S.A.	CPSG	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Corporación Financiera Alba S.A.	CSVG	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Fomento de Construcciones y Contratas S.A.	FCCG	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
Iberia Lineas Aereas de España S.A.	IBLG	ES01	XMAD	1000	0,0001	EUR
Red Electrica Corporación S.A.	RE2G	ES01	XMAD	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.

** Die minimale Preisveränderung bezieht sich bei Aktien-Futures mit zugewiesener Gruppenkennung GB01 auf Pence.

[…]

****

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 Preisverän-derung**	Währung
[…]						
~~Acciona S.A.~~	~~ANAF~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~10~~	~~0,001~~	~~EUR~~
~~ACS. Actividades de Construcción y Servicios S.A.~~	~~OCIF~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~50~~	~~0,001~~	~~EUR~~
~~Banco Pastor S.A.~~	~~BPQF~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~50~~	~~0,001~~	~~EUR~~
~~Compañía Española de Petróleos S.A.~~	~~CPSF~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~50~~	~~0,001~~	~~EUR~~
~~Corporación Financiera Alba S.A.~~	~~CSVF~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~50~~	~~0,001~~	~~EUR~~
~~Fomento de Construcciones y Contratas S.A.~~	~~FCCF~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~50~~	~~0,001~~	~~EUR~~
~~Iberia Lineas Aereas de España S.A.~~	~~IBLF~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~500~~	~~0,0001~~	~~EUR~~
~~Red Electrica Corporación S.A.~~	~~RE2F~~	~~ES01~~	~~XMAD~~	~~50~~	~~0,001~~	~~EUR~~
[…]						

** Die Gruppenkennung sowie die Kassamarkt-ID wird von den Eurex-Börsen entsprechend der nachfolgenden Tabelle vergeben und dient unter anderem der Festlegung eines Handelsplatzes für den Preis der dem Kontrakt zugrunde liegenden Aktie.

* Die minimale Preisveränderung bezieht sich bei Aktien-Futures mit zugewiesener Gruppenkennung GB01 auf Pence.

[…]

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 Preisverän-derung	Währung
[…]							
~~Sofina S.A.~~	~~SOF~~	~~BE12~~	~~XBRU~~	~~100~~	~~24~~	~~0,01~~	~~EUR~~
~~Ackermans & van Haaren N.V.~~	~~B3K~~	~~BE12~~	~~XBRU~~	~~100~~	~~24~~	~~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.

[…]