X-pand into the Future

# e u r e x *rundschreiben 169/10*

**Datum:** Frankfurt, 8. September 2010
**Empfänger:** Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
**Autorisiert von:** Peter Reitz

## Single Stock Futures: Einführung von zwei neuen US SSFs

**Verweis auf Eurex-Rundschreiben:** 232/07

**Kontakt:** Dr. Weiwei Wang, Product Development, Tel. +49-69-211-1 72 62,
E-Mail: weiwei.wang@eurexchange.com

| **Zielgruppe:** | **Anhang:** |
|---|---|
| Ü Alle Abteilungen | Geänderter Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich |

**Zusammenfassung:**

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von Aktien-Futures auf die US-amerikanischen Unternehmen Coca-Cola Enterprises Inc. und salesforce.com Inc. zum **13. September 2010** beschlossen.

# Single Stock Futures: Einführung von zwei neuen US SSFs

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von Aktien-Futures auf die US-amerikanischen Unternehmen Coca-Cola Enterprises Inc. und salesforce.com Inc. zum 13. September 2010 beschlossen.

Zur Umsetzung des Beschlusses werden die Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, wie im Anhang dargestellt, zum 13. September 2010 angepasst.

## 1. Produktüberblick

| Futures auf | Basiswert-ISIN | Gruppen-kennung | Produkt-währung | Produkt-kürzel | Produkt-ISIN | Produktkürzel Flexible Futures | | Kontrakt-größe | Minimale Preisver-änderung |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | Bar | Phy-sisch | | |
| Coca-Cola Enterprises Inc. | US1912191046 | US01 | USD | CEEF | DE000A1EZL05 | C4EF | - | 100 | 0,0001 |
| salesforce.com Inc. | US79466L3024 | US01 | USD | FOOF | DE000A1EZMA0 | FO4F | - | 100 | 0,001 |

Für die US-amerikanischen SSFs werden nur bar abgerechnete Flexible Futures zum Handelsstart zur Verfügung stehen.

## 2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Die Kontraktspezifikationen für die neuen Produkte sind identisch mit denen für die bereits bestehenden Single Stock Futures gemäß der Eurex-Gruppenkennung US01; 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. Zulassung zum OTC-Block-Trading

Die neuen SSFs werden zum OTC-Block-Trading zugelassen. Die Mindestgröße für Block Trades wird einen Kontrakt betragen.

## 4. Produktgruppe

| Gruppen-kennung | Produktgruppe | Settlement Location Unit | Regulatory Status | Settlement Type | Product Type | Product Segment | Product Currency | Produktgruppen-kürzel | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| US01 | Equity Futures mit Barabwicklung | - | N | C | F | SSF | USD | X | N | C | F | S | U |

Details zu den Produktgruppen entnehmen Sie bitte der unten stehenden Tabelle (nur in englischer Sprache):

| | Product Segment | | | | | | | | | | | | | | | | | | Product Type | | | Product Currency | | | | Settlement Type | | | | | | Settlement Location Unit (SLU) | | | | | | Regulatory Status | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Attributes | Interest Rate | Money Market | Equity Options | Exchange Traded Funds | Single Stock Futures | Equity Index | Volatility Index | Credit Derivatives | EEX Phelix Futures&Options | EEX German Power | EEX French Power | EEX Gas EGT | EEX Gas BEB | EEX EUA | EEX Coal | ENDEX Dutch Power | ENDEX Belgian Power | ENDEX Gas TTF | Future | Option | Future / Option | Euro | Swiss francs | GBP | USD | Cash | Physical Delivery | Derivate | Physical / Derivate | Cash / Physical | Cash / Derivate | CBON | CHF | EXS | Crest | FCUR | NEXS | Fully Approved | Approved w/o CCorp | Non-Approved |
| Abbr. | I | M | E | F | S | Q | V | C | P | D | N | G | B | A | K | U | W | T | F | O | H | E | C | G | U | C | P | D | F | S | E | B | S | E | C | F | N | F | A | N |

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

**5. Risikoparameter**

Die gültigen Risikoparameter werden nach dem 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 & Initial Margins**

**6. Mistrade-Parameter**

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

**www.eurexchange.com > Handel > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures > Auswahl nach Land**

**7. Transaktionslimite**

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs gemäß der Gruppenkennung US01. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

**www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite**

**8. Transaktionsentgelte**

Die Transaktionsentgelte für die US-amerikanischen SSFs betragen jeweils USD 0,30 pro Kontrakt; es gilt ein begrenztes Entgelt für OTC-Block-Trades von jeweils USD 300,00.

**9. Vendorenkürzel**

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

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

Frankfurt, 8. September 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 ** |
|---|---|---|---|---|---|---|
| […] | | | | | | |
| Coca-Cola Enterprises Inc. | CEFF | US01 | XNYS | 100 | 0,0001 | USD |
| salesforce.com Inc. | FOOF | US01 | XNYS | 100 | 0,001 | USD |
| […] | | | | | | |

* 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

[…]