Eurex-Rundschreiben 001/18

A. Aktien-Futures: Einführung von fünf Aktien-Futures;
B. Aktienoptionen: Einführung von sieben Aktienoptionen

Zusammenfassung

Die Geschäftsführung der Eurex Deutschland und die Geschäftsleitung der Eurex Zürich AG haben mit Wirkung zum **17. Januar 2018** die folgenden Beschlüsse gefasst:

1. Einführung von fünf Aktien-Futures gemäß Annex A aus dem Anhang;
2. Einführung von sieben Aktienoptionen gemäß Annex B aus dem Anhang,

Anhang:

Geänderte Annexe A und B der Kontraktspezifikationen
für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte
an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Datum: 12. Januar 2018

Empfänger:
Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren

Autorisiert von:
Mehtap Dinc

Zielgruppe:
Alle Abteilungen

Kontakt:
Derivatives Trading Operations,
T +49-69-211-1 12 10,
Nicolae Raulet,
T +44-207-8 62 72 74

A. Aktien-Futures: Einführung von fünf Aktien-Futures

1. Produktüberblick

Eurex-Produktkürzel	Future/ Aktiendividenden-Future auf	Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppenkennung	Produktwährung	Produkt-ISIN
ABNF	ABN AMRO Group NV	NL0011540547	NL01	EUR	DE000A2G9801
DHEF	Delivery Hero AG	DE000A2E4K43	DE01	EUR	DE000A2G9819
FBUF	Facebook Inc	US30303M1027	US02	USD	DE000A2G98Z4
GLPF	Galapagos NV	BE0003818359	BE01	EUR	DE000A2G98Y7
IFCF	Inficon Holding AG	CH0011029946	CH01	CHF	DE000A2G98X9

Eurex-Produktkürzel	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produktgruppe
ABNF	100	0,0001	10	ENSFSE
DHEF	100	0,0001	50	ENSFSE
FBUF	100	0,0001	10	XNCFSU
GLPF	100	0,0001	10	ENSFSE
IFCF	10	0,0001	10	SNSFSC

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Grundsätzlich sind die Kontraktspezifikationen für die neuen Aktien-Futures identisch mit denen für die bereits bestehenden Aktien-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.

Der aktualisierte Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich werden zum Produkteinführungsdatum der neuen Produkte auf der Eurex-Website www.eurexchange.com unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

3. Risikoparameter

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

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Die Risikoparameter für die neuen Produkte entnehmen Sie bitte der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link:

Risikomanagement > Risikoparameter

Dort finden Sie auch eine aktuelle Liste mit Details zu Prisma-fähigen Eurex-Produkten.

4. Mistrade-Parameter und Positionslimite

Mistrade Ranges und Positionslimite für die neuen Aktien-Futures stehen ab dem Handelsstart auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures

Produkte > Produktinformationen > Product specifications

5. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Werte wie für schon bestehende Aktien-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 sind analog zu den entsprechenden bestehenden Aktien-Futures.

7. Vendorenkürzel

Die Vendorenkürzel entnehmen Sie bitte ab Handelsstart der Eurex-Website unter dem Link:

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

8. Liquiditätsbereitstellung

Mit Wirkung zum ersten Handelstag werden die nachfolgenden Single Stock Futures in das Liquidity Provider Programm für Single Stock Futures (Equity-02) mit folgenden Parametern aufgenommen:

Programm	Single Stock Future auf	Produkt ID	Spreadklassen	Basis Minimum Quote Size
Others	Inficon Holding A.G.	IFCF	SSF 3	5
SSFNL	Galapagos N.V.	GLPF	SSF 3	5
Others	Facebook Inc	FBUF	SSF 3	5
SSFNL	ABN AMRO Group N.V.	ABNF	SSF 3	5
Others	Delivery Hero A.G.	DHEF	SSF 3	5

B. Aktienoptionen: Einführung von sieben Aktienoptionen

1. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Eurex-Produkt-kürzel	Option auf	Produkt-ISIN/ Basiswert-ISIN	Eurex-Gruppen-kennung	Produkt-währung	Maximale Laufzeit in Monaten
BG1	BAWAG Group AG	AT0000BAWAG2	AT12	EUR	24
EMM	Emmi AG	CH0012829898	CH12	CHF	24
HEN	Henkel AG & Co KGaA	DE0006048408	DE12	EUR	60
HLA	Hapag-Lloyd AG	DE000HLAG475	DE12	EUR	60
LEON	Leonteq AG	CH0190891181	CH12	CHF	24
LNDS	Landis+Gyr Group AG	CH0371153492	CH12	CHF	24
ROV	Rovio Entertainment Oy	FI4000266804	FI12	EUR	12

Eurex-Produkt-kürzel	Kontrakt-größe	Minimale Preis-veränderung	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
BG1	100	0,01	50	ENSOEE
EMM	10	0,01	50	SNSOEC
HEN	100	0,01	50	ENSOEE
HLA	100	0,01	50	ENSOEE
LEON	100	0,01	50	SNSOEC
LNDS	100	0,01	50	SNSOEC
ROV	100	0,01	10	ENSOEE

Der aktualisierte Annex B der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich wird zum Einführungsdatum der neuen Produkte auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Ressourcen > Regelwerke > Kontraktspezifikationen

2. Ausübungspreise

Die Aktienoptionen folgen dem aktuellen Eurex-Standard für Ausübungspreise der jeweiligen Gruppenkennung. Die Ausübungspreise sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

Die Kontraktspezifikationen für die neuen Produkte stehen auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link zur Verfügung:

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

3. Risikoparameter

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

Marktdaten > Clearing-Daten > Risikoparameter und Initial Margins

Die Risikoparameter für die neuen Produkte entnehmen Sie bitte der Eurex Clearing-Website www.eurexclearing.com unter dem folgenden Link:

Risikomanagement > Risikoparameter

Dort finden Sie auch eine aktuelle Liste mit Details zu Prisma-fähigen Eurex-Produkten.

4. Handelszeiten

Die Handelszeiten für die neuen Aktienoptionen entsprechen den jeweils gültigen Handelszeiten für die bereits vorhandenen Eurex-Gruppenkennungen und sind den Kontraktspezifikationen zu entnehmen.

5. Mistrade Ranges, Positionslimite

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

Produkte > Aktienderivate > Aktienoptionen

Produkte > Produktinformationen > Product specifications

6. Vendorenkürzel

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

Produkte > Vendoren Produkt-Codes

7. Handelskalender

Es gilt der jeweils bestehende Handelskalender für deutsche, schweizer, österreichische und finnische Aktienoptionen. Die Handelskalender finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Link:

Handel > Handelskalender

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

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

9. Eurex-T7-Entry-Services

Die Flexible Options-Funktionalität wird unter Anerkennung der Allgemeinen Teilnahmebedingungen zur Verfügung stehen.

Eine Übersicht der für die Produkte zur Verfügung stehenden Eurex T7 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.

In der CSV-Datei „Trading Parameters“ ist der Produktparameter „Block Volume Publication Limit“ (siehe Spalte „Non Disclosure 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 CSV-Datei sind auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link verfügbar:

Handel > Eurex T7 Entry Services > T7 Entry Service-Parameter

10. Liquiditätsklassen

Eurex Clearing AG gewährt Rabatte für die Liquiditätsbereitstellung gemäß des Eurex Liquidity Provider Agreements und Ziffer 3.2.1.1 des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG für Aktienindex-, Aktien- (mit in Annex B der Eurex-Kontraktspezifikationen zugewiesener Gruppenkennungsendung “11”, “12” oder “13”) und Zinsoptionen. Eurex Clearing AG gewährt Volumenrabatte gemäß Ziffer 3.2.2 des Preisverzeichnisses der Eurex Clearing AG für Aktienindex-, Aktien- und Zinsoptionen sowie Aktienindex- und Zinsfutures. Die Rabatte für Liquiditätsbereitstellung und die Volumenrabatte werden in Abhängigkeit zu der Liquiditätsklasse (LC) gewährt, die einem Produkt zugeordnet ist. Die Umsetzung erfolgt durch die Einführung von drei LCs: LC1, LC2 und LC3 – dabei repräsentiert LC1 liquide Produkte und LC3 weniger liquide Produkte. Die Produktliste mit jeweiligen Liquiditätsklassen wird auf der Eurex-Website unter dem folgenden Link veröffentlicht:

Produkte > Produktinformationen

Für eine automatisierte Verarbeitung der Liquiditätsklassenliste (Download) wird die Datei zusätzlich im öffentlichen Bereich der Common Reporting Engine (CRE) veröffentlicht.

11. Liquiditätsbereitstellung

Mit Wirkung zum ersten Handelstag werden die nachfolgenden Equity Options in das Liquidity Provider Programm für Equity Options (Equity-01) mit folgenden Parametern aufgenommen:

Programm	Option auf	Produkt-ID	Paket-ID	Spreadklasse	Basis Minimum Quote Size	Anzahl der zu quotierenden Verfälle; die ersten
Non-Package	BAWAG Group A.G.	BG1	-	OSTK 7	10	4
Non-Package	Rovio Entertainment Oy	ROV	-	OSTK 7	10	6
Non-Package	Hapag-Lloyd A.G.	HLA	-	OSTK 8	10	6
Non-Package	Henkel AG & Co KGaA	HEN	-	OSTK 8	10	6
Non-Package	Emmi A.G.	EMM	-	OSTK 10	10	6
Non-Package	Leonteq A.G.	LEON	-	OSTK 10	10	6
Non-Package	Landis+Gyr Group A.G.	LNDS	-	OSTK 10	10	6

Wenn Sie Fragen haben oder weitere Informationen benötigen, wenden Sie sich bitte an Derivatives Trading Operations unter T +49-69-211-1 12 10 oder Nicolae Raulet unter T +44-207-8 62 72 74.

12. Januar 2018

****

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 **	Mindest-anzahl der zu handelnd en Kontrakte
[…]							
ABN AMRO Group N.V.	ABNF	NL01	XAMS	100	0,0001	EUR	10
Delivery Hero AG	DHEF	DE01	XETR	100	0,0001	EUR	50
Facebook Inc.	FBUF	US02	XNAS	100	0,0001	USD	10
Galapagos N.V.	GLPF	BE01	XBRU	100	0,0001	EUR	10
Inficon Holding AG	IFCF	CH01	XSWX	10	0,0001	CHF	10
[…]							

* 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 B zu Ziffer 2.6 der Kontraktspezifikationen:

Optionen auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Maximale Laufzeit (Monate)	Minimale Preisver-änderung	Währung **	Mindest-anzahl der zu handelnden Kontrakte
[…]								
BAWAG Group AG	BG1	AT12	XVI1	100	24	0,01	EUR	50
Emmi AG	EMM	CH12	XSWX	10	24	0,01	CHF	50
Hapag-Lloyd AG	HLA	DE12	XETR	100	60	0,01	EUR	50
Henkel AG & Co KGaA	HEN	DE12	XETR	100	60	0,01	EUR	50

Optionen auf Aktien der	Produkt-ID	Gruppen-kennung*	Kassa-markt-ID*	Kontrakt-größe	Maximale Laufzeit (Monate)	Minimale Preisver-änderung	Währung **	Mindest-anzahl der zu handelnden Kontrakte
Landis+Gyr Group AG	LNDS	CH12	XSWX	100	24	0,01	CHF	50
Leonteq AG	LEON	CH12	XSWX	100	24	0,01	CHF	50
Rovio Entertainment Oy	ROV	FI12	XHEL	100	12	0,01	EUR	10
[…]								

* 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

****