X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 088/09*

Datum: Frankfurt, 15. Mai 2009
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

UniCredit SpA und Abertis Infraestructuras: Einführung von SSFs aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 080/09, 081/09

Kontakt: Alexey Weizmann (Eurex Product Strategy), Tel. +49-69-211-1 97 33,
E-Mail: alexey.weizmann@eurexchange.com

Zielgruppe:

Ü Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderte Abschnitte von 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 aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung von neuen Single Stock Futures auf UniCredit SpA und Abertis Infraestructuras zum **18. Mai 2009** beschlossen.

UniCredit SpA und Abertis Infraestructuras: Einführung von SSFs aufgrund von Kapitalmaßnahmen

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben aufgrund von Kapitalmaßnahmen die Einführung von neuen Single Stock Futures auf UniCredit SpA und Abertis Infraestructuras zum 18. Mai 2009 beschlossen.

1. Produktüberblick

Produkt-kürzel	Futures auf	Basiswert ISIN	Eurex-Länder-kennung	Produkt-währung	Produkt-ISIN	Produktkürzel Flexible Futures	
						Bar	Phy-sisch
CR5G	UniCredit SpA	IT0000064854	IT01	EUR	DE000A0ZW340	C45G	C55G
ABEH	Abertis Infra-estructuras	ES0111845014	ES01	EUR	DE000A0ZW357	AB4H	AB5H

Produkt-kürzel	Kon-trakt-größe	Minimale Preisverän-derung*	Mindestgröße für Block Trades	Produkt-gruppe
CR5G	1000	0,0001	1	ENSFSE
ABEH	100	0,0001	1	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 gemäß der Eurex-Länderkennung; 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 für die SSFs 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 gemäß der Eurex-Länderkennung. Detaillierte Informationen dazu finden Sie auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

www.eurexchange.com > Technologie > Transaktionslimite

6. Transaktionsentgelte

Die Transaktionsentgelte für die neuen Single Stock Futures 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

Frankfurt, 15. Mai 2009

[…]

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
[…]						
Abertis Infraestructuras S.A.	ABEH	ES01	XMAD	100	0,0001	EUR
UniCredit SpA~~UniCredito Italiano S.p.A.~~	CR5F	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
UniCredit SpA	CR5G	IT01	XMIL	1000	0,0001	EUR
[…]						

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

** 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.

[…]

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
[…]							
UniCredit SpA ~~UniCredito Italiano S.p.A.~~	CRI5	IT11	XMIL	1000	60	0,0005	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.

[…]