X-pand into the Future

e u r e x *rundschreiben 084/10*

Datum: Frankfurt, 14. Mai 2010
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Peter Reitz

Single Stock Futures: Einführung von zwei neuen 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:

Ü Alle Abteilungen

Anhang:

Geänderter Annex A der Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich

Zusammenfassung:

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von Aktien-Futures auf das US-amerikanische Unternehmen Millicom International Cellular S.A. und auf das österreichische Unternehmen BWT AG zum **18. Mai 2010** beschlossen.

Single Stock Futures: Einführung von zwei neuen SSFs

Die Geschäftsführungen der Eurex-Börsen und der Vorstand der Eurex Clearing AG haben die Einführung von Aktien-Futures auf das US-amerikanische Unternehmen Millicom International Cellular S.A. und auf das österreichische Unternehmen BWT AG zum 18. Mai 2010 beschlossen.

Zur Umsetzung des Beschlusses werden die Kontraktspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und der Eurex Zürich, wie im Anhang dargestellt, zum 18. Mai 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	Physisch		
Millicom International Cellular S.A.	LU0038705702	US02	USD	MICF	DE000A1DKNF1	M4CF	-	100	0,001
BWT AG	AT0000737705	AT01	EUR	BWTF	DE000A1DKNG9	B4TF	B5TF	100	0,0001

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

2. Kontraktspezifikationen und Produktparameter

Die Kontraktspezifikationen für die neuen SSFs sind identisch mit denen für die bereits bestehenden Single Stock Futures gemäß den Eurex-Gruppenkennungen US02 und AT01; 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					
US02	Equity Futures cash-settled	-	N	C	F	SSF	USD	X	N	C	F	S	U
AT01	Equity Futures cash-settled	E	N	S	F	SSF	EUR	E	N	S	F	S	E

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 CComp	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 Eurex-Rundschreiben 232/07, Abschnitt 1.6.

5. 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 & Initial Margins

6. Mistrade-Parameter

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

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

7. Transaktionslimite

Es gelten die gleichen Transaktionslimite wie für schon bestehende SSFs gemäß den Gruppenkennungen US02 und AT01. 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 und österreichischen SSFs betragen jeweils USD 0,30 bzw. EUR 0,20 pro Kontrakt; es gilt ein begrenztes Entgelt für OTC Block-Trades von jeweils USD 300,00 bzw. EUR 200,00.

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, 14. Mai 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
[…]						
Millicom International Cellular S.A.	MICF	US02	XNAS	100	0,001	USD
BWT AG	BWTF	AT01	XVIE	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.

[…]