



eurex clearing

rundschreiben 035/10

Datum: Frankfurt, 1. Juni 2010
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich
Autorisiert von: Peter Reitz

Erweiterung der Eurex/EEX-Kooperation:
Einführung zusätzlicher Verfalldaten in Phelix Base-Jahresoptionen

Verweis auf EEX-Rundschreiben: ECC-Clearing Information vom 22. April 2010

Kontakt: Derivatives Trading Operations, Tel. +49-69-211-1 12 10,
 Marktsteuerung European Energy Exchange, Tel. +49-341-21 56-2 22
 European Commodity Clearing AG, Tel. +49-341-24 68 04 44

Zielgruppe:

➔ Alle Abteilungen

Anhang:

Nur in englischer Sprache, nur auf der ECC-Website:
 „ECC Contract Details“, csv-Datei

Zusammenfassung:

Nachfolgend erhalten Sie Informationen zur Einführung des Handels in zusätzlichen Verfalldaten für Phelix Base-Jahresoptionen am EEX-Terminmarkt bezüglich des Aufsetzens der neuen Produkte, der Member Readiness und der geplanten Simulation.

Die neuen Verfalldaten stehen ab dem **28. Juni 2010** zur Verfügung.

Im Rahmen der Eurex/EEX-Kooperation werden die neuen Kontrakte auch den Eurex-Handelsteilnehmern zur Verfügung stehen.

Erweiterung der Eurex/EEX-Kooperation:
Einführung zusätzlicher Verfalldaten in Phelix Base-Jahresoptionen

Am 28. Juni 2010 führt die European Energy Exchange (EEX) neue Verfalldaten für EEX Phelix Base-Jahresoptionen ein. Zusätzlich zu den bestehenden Dezember-Verfalldaten bietet EEX neue Quartalsverfalldaten für Phelix Base-Jahresoptionen. Mit diesem Eurex Clearing-Rundschreiben möchten wir Informationen bezüglich des Aufsetzens der Produkte, der Member Readiness und der geplanten Simulation zur Verfügung stellen.

1. Aufsetzen der Produkte

Die an EEX handelbaren Phelix Base-Jahresoptionen werden wie folgt in das Eurex®-System integriert:

ISIN	WKN	Produktkürzel	Name
DE000A0AEQN9	A0AEQN	O1BY	Phelix Base Year Option

Die CSV-Datei „ECC Contract Details“, welche in komprimierter Form die Kontrakt-details inklusive aller benötigter Produktinformationen für Ihre Vorbereitungen enthält, wurde um die folgenden drei Spalten ergänzt: „UL_PRODUCT_ID“, „UL_EXPIRY_YEAR“ und „UL_EXPIRY_MONTH“. Diese Spalten enthalten das Basiswert-Produktkürzel, z.B. F1BY, das Verfallsjahr des Basiswerts, z.B. 2010 und den Verfallsmonat, z.B. „1“ für Januar.

Die CSV-Datei steht auf der ECC-Website unter dem folgenden Pfad zum Herunterladen bereit:

www.ecc.de > Downloads > Documentation > Product Details

Die untenstehende Tabelle enthält einen Überblick der Verfallmonate und Lieferdaten für EEX Phelix Base-Jahresoptionen in 2010 und 2011. Weitere Verfalldaten entnehmen Sie bitte dem Dokument „ECC Contract Details“:

Optionskontrakt	Verfallsdatum	Basiswert
O1BY OCT10	27.09.2010	F1BY JAN11
O1BY APR11	28.03.2011	F1BY JAN12
O1BY JUL11	27.06.2011	F1BY JAN12
O1BY OCT11	27.09.2011	F1BY JAN12

Jeder Verfall wird mit drei Basispreisen aufgesetzt. Zusätzliche Basispreise können angefordert werden und stehen mit einem Tag Verzögerung im Eurex®-System zur Verfügung.

2. Member Readiness

Die ECAG Clearing-Lizenz für Clearing-Mitglieder zur Abwicklung von EEX-Kooperationsprodukten und die Zulassung als Handelsteilnehmer in EEX Phelix-Optionen beinhaltet bereits die Abwicklung von neuen Verfalldaten. D. h. es müssen keine zusätzlichen Antragsformulare eingereicht werden.

3. Simulation

Zum Testen innerhalb der Eurex-Simulationsumgebung steht ein zusätzlicher Kontrakt (O1BT) mit monatlichem Verfall zur Verfügung. Die nächsten verfügbaren Verfalldaten für O1BT (EEX Phelix Base-

e u r e x c l e a r i n g r u n d s c h r e i b e n 0 3 5 / 1 0

Jahresoption Test) in der Eurex-Simulationsumgebung sind der 25. Mai 2010 (O1BT MAY 2010) und 24. Juni 2010 (O1BT JUN 2010).

Nähere Informationen zu den neuen Kontrakten finden Sie in den „EEX-Kontraktsspezifikationen“ auf der EEX-Website unter dem Pfad:

www.eex.com > Downloads > Dokumentation > Verordnungen und Regelwerke

und in den „Kontraktetails“ auf der EEX-Website unter dem Pfad:

www.eex.com > Downloads > Dokumentation > Konzepte und Beschreibungen

Frankfurt, 1. Juni 2010