



## eurex rundschriften 241/07

**Datum:** Frankfurt, 21. November 2007  
**Empfänger:** Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren  
**Autorisiert von:** Peter Reitz

### Aktien-Futures: Einführung zusätzlicher SSFs (Block 3, 4 und 5)

**Verweis auf Eurex-Rundschriften:** 085/06, 024/07, 080/07, 193/07, 207/07; 232/07

**Kontakt:** Dr. Weiwei Wang (Product Strategy), Tel. +49-69-211-1 72 62,  
E-Mail: [Weiwei.Wang@eurexchange.com](mailto:Weiwei.Wang@eurexchange.com)

**Zielgruppe:**

Ü Alle Abteilungen

**Anhänge:**

Geänderte Abschnitte der

1. Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich zum 10. Dezember 2007
2. Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich zum 17. Dezember 2007
3. Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland und Eurex Zürich zum 7. Januar 2008
4. Bedingungen für die Nutzung der OTC-Trade-Entry-Funktionalitäten (Allgemeine Teilnahmebedingungen) zum 17. Dezember 2007

**Zusammenfassung:**

Wie in Eurex-Rundschriften 193/07 mitgeteilt, erweitert Eurex das Single Stock Futures-Segment um bis zu 170 Komponenten der Indizes Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 600, RDXxt<sup>®</sup> USD und S&P 500.

Handelsstart für den dritten, vierten und fünften Block mit insgesamt 56 Single Stock Futures ist jeweils der **10. und 17. Dezember 2007** sowie der **7. Januar 2008**. Dieses Rundschreiben enthält alle Einzelheiten zu den neuen Produkten.



**Aktien-Futures: Einführung zusätzlicher SSFs (Block 3, 4 und 5)****1. Einführungsdatum**

Wie in Eurex-Rundschreiben 193/07 mitgeteilt, erweitert Eurex das Single Stock Futures-Segment um bis zu 170 Komponenten der Indizes Dow Jones STOXX<sup>®</sup> 600, RDXxt<sup>®</sup> USD und S&P 500.

Handelsstart für den dritten, vierten und fünften Block mit insgesamt 56 Single Stock Futures ist jeweils der 10. und 17. Dezember **2007** sowie der 7. Januar 2008. Dieses Rundschreiben enthält alle Einzelheiten zu den neuen Produkten.

**2. Produktüberblick**

Nr.	Futures auf	Basiswert-ISIN	SSF Eurex- Kürzel	Produkt-ISIN	Eurex Länder- kürzel	Eurex- Währung	Kontrakt- größe	Minimale Preisver- änderung*
<b>Block 3 (Handelsstart: 10. Dezember 2007)</b>								
1	Associated British Foods PLC	GB0006731235	ABFF	DE000A0SYCN9	GB	GBP	1000	0,01
2	Barratt Developments PLC	GB0000811801	BDEF	DE000A0SYCG3	GB	GBP	1000	0,01
3	Enterprise Inns Plc	GB00B1L8B624	ETIF	DE000A0SYCH1	GB	GBP	1000	0,01
4	Home Retail Group PLC	GB00B19NKB76	HOMF	DE000A0SYB86	GB	GBP	1000	0,01
5	Intercontinental Hotels Group PLC	GB00B1WQCS47	IHGF	DE000A0SYCC2	GB	GBP	1000	0,01
6	Invensys PLC	GB00B19DVX61	ISYF	DE000A0SYCP4	GB	GBP	1000	0,01
7	ITV PLC	GB0033986497	ITVF	DE000A0SYCF5	GB	GBP	1000	0,01
8	Liberty International PLC	GB0006834344	LIIF	DE000A0SYCK5	GB	GBP	1000	0,01
9	Mitchells & Butlers PLC	GB00B1FP6H53	MABF	DE000A0SYCL3	GB	GBP	1000	0,01
10	Persimmon PLC	GB0006825383	PSNF	DE000A0SYCE8	GB	GBP	1000	0,01
11	Punch Taverns PLC	GB0031552861	PUBF	DE000A0SYCM1	GB	GBP	1000	0,01
12	Rexam PLC	GB0004250451	REXF	DE000A0SYCJ7	GB	GBP	1000	0,01
13	Severn Trent PLC	GB00B1FH8J72	SVTF	DE000A0SYCQ2	GB	GBP	1000	0,01
14	Tullow Oil PLC	GB0001500809	TLWF	DE000A0SYCA6	GB	GBP	1000	0,01
15	Whitbread PLC	GB00B1KJJ408	WTBF	DE000A0SYCD0	GB	GBP	1000	0,01
16	Yell Group PLC	GB0031718066	YELF	DE000A0SYB78	GB	GBP	1000	0,01
<b>Block 4 (Handelsstart: 17. Dezember 2007)</b>								
1	Antofagasta PLC	GB0000456144	ANTF	DE000A0SYCU4	GB	GBP	1000	0,01
2	Bradford & Bingley PLC	GB0002228152	BBFF	DE000A0SYCZ3	GB	GBP	1000	0,01
3	British Airways PLC	GB0001290575	BAIF	DE000A0SYC93	GB	GBP	1000	0,01
4	Burberry Group PLC	GB0031743007	BRBF	DE000A0SYCW0	GB	GBP	1000	0,01
5	Cairn Energy Plc	GB00B1RZDL64	CNEF	DE000A0SYDA4	GB	GBP	1000	0,01
6	Drax Group PLC	GB00B1VNSX38	D9FF	DE000A0SYC36	GB	GBP	1000	0,01
7	DSG International PLC	GB0000472455	DSGF	DE000A0SYCS8	GB	GBP	1000	0,01
8	Firstgroup Plc	GB0003452173	FGPF	DE000A0SYCV2	GB	GBP	1000	0,01
9	G4S PLC	GB00B01FLG62	GFSF	DE000A0SYC44	GB	GBP	1000	0,01
10	GKN PLC	GB0030646508	GKNF	DE000A0SYC10	GB	GBP	1000	0,01

Nr.	Futures auf	Basiswert-ISIN	SSF Eurex- Kürzel	Produkt-ISIN	Eurex Länder- kürzel	Eurex- Währung	Kontrakt- größe	Minimale Preisver- änderung*
11	ICAP PLC	GB0033872168	IAPF	DE000A0SYC28	GB	GBP	1000	0,01
12	Investec PLC	GB00B17BBQ50	INVF	DE000A0SYC69	GB	GBP	1000	0,01
13	Kazakhmys PLC	GB00B0HZPV38	KAZF	DE000A0SYCY6	GB	GBP	1000	0,01
14	Kelda Group Plc	GB00B1KQN728	KELF	DE000A0SYC85	GB	GBP	1000	0,01
15	Ladbrokes PLC	GB00B0ZSH635	LADF	DE000A0SYC02	GB	GBP	1000	0,01
16	LogicaCMG PLC	GB0005227086	LOQF	DE000A0SYC77	GB	GBP	1000	0,01
17	Rentokil Initial PLC	GB00B082RF11	RTOF	DE000A0SYCT6	GB	GBP	1000	0,01
18	Sage Group PLC	GB0008021650	SGKF	DE000A0SYCR0	GB	GBP	1000	0,01
19	Segro PLC	GB00B1YFN979	SGRF	DE000A0SYC51	GB	GBP	1000	0,01
20	Tate & Lyle PLC	GB0008754136	TATF	DE000A0SYCX8	GB	GBP	1000	0,01
<b>Block 5 (Handelsstart: 7. Januar 2008)</b>								
1	Amlin PLC	GB0000319581	AMLF	DE000A0SYDR8	GB	GPB	1000	0,01
2	Bunzl PLC	GB00B0744B38	BNZF	DE000A0SYDC0	GB	GPB	1000	0,01
3	Carphone Warehouse Group PLC	GB0008787029	CPWF	DE000A0SYD01	GB	GPB	1000	0,01
4	Cobham PLC	GB00B07KD360	COBF	DE000A0SYDH9	GB	GPB	1000	0,01
5	Daily Mail & General Trust	GB0009457366	DMGF	DE000A0SYDF3	GB	GPB	1000	0,01
6	IMI Plc	GB0004579636	IMIF	DE000A0SYDN7	GB	GPB	1000	0,01
7	Inchcape Plc	GB00B10QTX02	INCF	DE000A0SYDJ5	GB	GPB	1000	0,01
8	Informa PLC	GB0002625654	INFF	DE000A0SYDB2	GB	GPB	1000	0,01
9	London Stock Exchange Group PLC	GB00B0SWJX34	LSEF	DE000A0SYDM9	GB	GPB	1000	0,01
10	Premier Foods PLC	GB00B01QLV45	PFDG	DE000A0SYDD8	GB	GPB	1000	0,01
11	Provident Financial Plc	GB00B1Z4ST84	PFGF	DE000A0SYDS6	GB	GPB	1000	0,01
12	Schroders PLC	GB0002405495	SDRF	DE000A0SYDQ0	GB	GPB	1000	0,01
13	Tomkins Plc	GB0008962655	TOMF	DE000A0SYDG1	GB	GPB	1000	0,01
14	Travis Perkins PLC	GB0007739609	TPKF	DE000A0SYDK3	GB	GPB	1000	0,01
15	United Business Media PLC	GB00B1TQY924	UBMF	DE000A0SYDL1	GB	GPB	1000	0,01
16	Vedanta Resources PLC	GB0033277061	VR9F	DE000A0SYDP2	GB	GPB	1000	0,01
17	Polyus Gold Co	US6781291074	PLZF	DE000A0SYDT4	RU	USD	100	0,01
18	TMK OAO	US87260R2013	TMKF	DE000A0SYDU2	RU	USD	100	0,01
19	VTB Bank OJSC	US46630Q2021	VTBF	DE000A0SYDV0	RU	USD	100	0,01
20	William Hill PLC	GB0031698896	WMHF	DE000A0SYDE6	GB	GBP	1000	0,01

\* Alle in britischen Pfund denominierten SSFs werden in Pence quotiert.

### 3. Kontraktsspezifikationen und Produktparameter

Die Kontraktsspezifikationen der neuen SSFs entsprechen den jeweiligen Kontraktsspezifikationen der bereits bestehenden Ländersegmente. Details dazu sind in den unten stehenden Tabellen enthalten. Die Kontraktsspezifikationen für die US-amerikanischen SSFs in US-Dollar werden zu einem späteren Zeitpunkt veröffentlicht.

<b>Kontraktgröße</b>	1, 10, 50, 100, 500 oder 1000 Aktien
<b>Minimale Preisveränderung</b>	EUR 0,0005, EUR 0,01, CHF 0,01 oder 0,01 Pence
<b>Laufzeiten</b>	Bis zu drei Jahren; die nächsten dreizehn aufeinander folgenden Kalendermonate und die beiden nächsten Jahresmonate aus dem Dezember-Zyklus
<b>Letzter Handelstag</b>	Der dritte Freitag, für Futures auf italienische Aktien der Tag vor dem dritten Freitag des jeweiligen Kontraktmonats, wenn dieser Tag ein Börsenhandelstag ist, ansonsten der direkt davor liegende Börsenhandelstag
<b>Settlement</b>	Erfüllung durch Barausgleich auf Basis des letzten Abrechnungspreises, fällig am ersten Börsenhandelstag nach dem letzten Handelstag
<b>Täglicher Abrechnungspreis</b>	Von Eurex ermittelt auf Basis des durch das elektronische Handelssystem der jeweiligen Börse des Basiswerts errechneten Schlusskurses der entsprechenden Aktien plus der jeweiligen „costs of carry“
<b>Schlussabrechnungspreis</b>	Von Eurex ermittelt auf Basis des durch das elektronische Handelssystem der jeweiligen Börse des Basiswerts am letzten Handelstag errechneten Schlusskurses der entsprechenden Aktien

### 4. Handelszeiten

<b>Futures-Kontrakte auf Aktien von</b>	<b>Länderkürzel</b>	<b>Pre- Trading- Periode</b>	<b>Fortlaufender Handel*</b>	<b>Post- Trading Full-Periode</b>	<b>OTC Block- Trading</b>	<b>Letzter Handelstag</b> Handel bis
belgischen französischen griechischen holländischen irischen italienischen österreichischen portugiesischen und spanischen Aktiengesellschaften	BE FR GR NL IE IT AT PT ES	07:30-08:50	08:50-17:45	17:45-18:30	09:00-18:30	17:45
deutschen Aktiengesellschaften	DE	07:30-08:51	08:51-17:45	17:45-18:30	09:00-18:30	17:45
britischen Aktiengesellschaften	GB	07:30-08:55	08:55-17:45	17:45-18:30	09:00-18:30	17:45
schweizerischen und skandinavischen (finnischen, norwegischen, schwedischen) Aktiengesellschaften	CH (FI/NO/ SE)	07:30-08:52	08:52-17:45	17:45-18:30	09:00-18:30	17:45

Futures-Kontrakte auf Aktien von	Länderkürzel	Pre-Trading-Periode	Fortlaufender Handel*	Post-Trading Full-Periode	OTC Block-Trading	Letzter Handelstag Handel bis
russischen Aktiengesellschaften	RU	07:30-08:53	08:53-17:45	17:45-18:30	09:00-18:30	16:40

\* Der Handel in Aktien-Futures-Kontrakten beginnt im Anschluss an den Handelsbeginn in Aktienoptionen; alle Zeitangaben in MEZ.

## 5. Zulassung zum Block-Trading

Alle SSFs, einschließlich der neuen, werden zum OTC-Block-Trading zugelassen. Die Preise für Block Trades werden validiert gegen die aktuellen Marktpreise des entsprechenden Basiswerts (siehe Anhang 4). Die Mindestgröße für Block Trades wird einen Kontrakt betragen.

## 6. OTC Flexible Futures

In OTC Flexible Futures werden flexible Verfalldaten für alle neuen SSFs verfügbar sein. Physische Lieferung hingegen ist, wie in Eurex-Rundschreiben 232/07 (Anhang 10, S. 1) angekündigt, vorläufig noch nicht möglich für SSFs auf britische Aktien und russische ADRs.

Die vorhandene Produktkürzellogik für OTC Flexible Futures (siehe Eurex-Rundschreiben 232/07, Abschnitt 1.8.1, S. 10) kommt bei den neuen Produkten zur Anwendung. Das Produktkürzel für Flexible Futures auf Punch Taverns PLC (ISIN des Basiswertes: GB0031552861) wird PUB4 statt PU4F sein.

## 7. Margin-Parameter

Nr.	Basiswert	Eurex-Produktkürzel	Margin-Klasse	Eurex-Währung	Initial Margin	Margin-Parameter (absolut)	Spot & Back Rate
<b>Block 3 (Handelsstart: 10. Dezember 2007)</b>							
1	Associated British Foods PLC	ABFF	ABF	GBP	860	86	220
2	Barratt Developments PLC	BDEF	BDE	GBP	820	82	405
3	Enterprise Inns Plc	ETIF	ETI	GBP	620	62	165
4	Home Retail Group PLC	HOMF	HOM	GBP	430	43	150
5	Intercontinental Hotels Group PLC	IHGF	IHG	GBP	1040	104	245
6	Invensys PLC	ISYF	ISY	GBP	370	37	115
7	ITV PLC	ITVF	ITV	GBP	100	10	40
8	Liberty International PLC	LIIF	LII	GBP	1110	111	365
9	Mitchells & Butlers PLC	MABF	MAB	GBP	640	64	150
10	Persimmon PLC	PSNF	PSN	GBP	1260	126	580
11	Punch Taverns PLC	PUBF	PUB	GBP	1010	101	165
12	Rexam PLC	REXF	REX	GBP	550	55	220
13	Severn Trent PLC	SVTF	SVT	GBP	1420	142	690
14	Tullow Oil PLC	TLWF	TLW	GBP	650	65	65
15	Whitbread PLC	WTBF	WTB	GBP	1730	173	355
16	Yell Group PLC	YELF	YEL	GBP	450	45	90

Nr.	Basiswert	Eurex-Produkt-kürzel	Margin-Klasse	Eurex-Währung	Initial Margin	Margin-Parameter (absolut)	Spot & Back Rate
<b>Block 4 (Handelsstart: 17. Dezember 2007)</b>							
1	Antofagasta PLC	ANTF	ATO	GBP	980	98	250
2	Bradford & Bingley PLC	BBFF	BBF	GBP	430	43	205
3	British Airways PLC	BAIF	BAI	GBP	520	52	160
4	Burberry Group PLC	BRBF	BRB	GBP	790	79	110
5	Cairn Energy Plc	CNEF	CNE	GBP	3180	318	900
6	Drax Group PLC	D9FF	D9F	GBP	980	98	50
7	DSG International PLC	DSGF	DSG	GBP	130	13	100
8	Firstgroup Plc	FGPF	FGP	GBP	1020	102	160
9	G4S PLC	GFSF	GFS	GBP	300	30	50
10	GKN PLC	GKNF	GKN	GBP	460	46	130
11	ICAP PLC	IAPF	IAP	GBP	870	87	125
12	Investec PLC	INVF	INV	GBP	760	76	230
13	Kazakhmys PLC	KAZF	KAZ	GBP	1850	185	445
14	Kelda Group Plc	KELF	KEL	GBP	1280	128	325
15	Ladbrokes PLC	LADF	LAD	GBP	530	53	135
16	LogicaCMG PLC	LOQF	LOQ	GBP	200	20	55
17	Rentokil Initial PLC	RTOF	RTO	GBP	170	17	85
18	Sage Group PLC	SGKF	SGK	GBP	240	24	45
19	Segro PLC	SGRF	SGR	GBP	620	62	320
20	Tate & Lyle PLC	TATF	TAT	GBP	580	58	220
<b>Block 5 (Handelsstart: 7. Januar 2008)</b>							
1	Amlin PLC	AMLF	AML	GBP	450	45	225
2	Bunzl PLC	BNZF	BNZ	GBP	930	93	175
3	Carphone Warehouse Group PLC	CPWF	CPW	GBP	500	50	40
4	Cobham PLC	COBF	COB	GBP	280	28	44
5	Daily Mail & General Trust	DMGF	DMG	GBP	790	79	155
6	IMI Plc	IMIF	IMI	GBP	730	73	220
7	Inchcape Plc	INCF	INC	GBP	610	61	175
8	Informa PLC	INFF	INF	GBP	670	67	50
9	London Stock Exchange Group PLC	LSEF	LSE	GBP	2470	247	810
10	Premier Foods PLC	PFDf	PRF	GBP	300	30	45
11	Provident Financial Plc	PFGF	PFG	GBP	1190	119	285
12	Schroders PLC	SDRF	SDRF	GBP	1970	197	300
13	Tomkins Plc	TOMF	TOM	GBP	280	28	160
14	Travis Perkins PLC	TPKF	TPK	GBP	1870	187	450
15	United Business Media PLC	UBMF	UBM	GBP	960	96	695
16	Vedanta Resources PLC	VR9F	VR9	GBP	2720	272	200
17	William Hill PLC	WMHF	WMH	GBP	810	81	250
18	Polyus Gold Co	PLZF	PLZ	USD	700	7	21
19	TMK OAO	TMKF	TMK	USD	490	4.9	100
20	VTB Bank OJSC	VTBF	VTB	USD	530	5.3	3

**8. Mistrade-Parameter**

Mistrade Ranges für die SSFs stehen ab dem jeweiligen Handelsstart (10. und 17. Dezember 2007 sowie 7. Januar 2008) auf der Eurex-Website unter dem Pfad zu SSFs zur Verfügung:

**[www.eurexchange.com](http://www.eurexchange.com) > Handel > Produkte > Aktienderivate > Aktien-Futures**

**9. Transaktionslimite**

Es gelten jeweils die gleichen Werte wie für die bereits handelbaren SSFs. Detaillierte Informationen dazu finden Sie ab dem ersten Handelstag auf der Eurex-Website unter dem Pfad:

**[www.eurexchange.com](http://www.eurexchange.com) > Technologie > Transaktionslimite**

**10. Transaktionsentgelte**

Die Transaktionsentgelte gelten analog zu den SSFs in den bestehenden Ländersegmenten.

**11. Vendorenkürzel**

Die Vendorenkürzel entnehmen Sie bitte ab Handelsstart, dem 10. und 17. Dezember 2007 sowie dem 7. Januar 2008, unserer Website unter dem Pfad:

**[www.eurexchange.com](http://www.eurexchange.com) > Handel > Produkte > Suche nach Produktcodes von Datenanbietern**

**12. Vorbereitungen zum Handelsstart**

SSFs	Aufsetzen neuer Produkte und der dazu gehörigen Margin-Klassen (Dienstag)	Übertragung der Settlement-Preise für alle handelbaren Kontraktmonate; Generierung der Transaktionen für die PMI-Datei* (Mittwoch bis Freitag)	Handelsstart (Montag)
Block 3	4. Dezember 2007	4.-7. Dezember 2007	10. Dezember 2007
Block 4	11. Dezember 2007	11.-14. Dezember 2007	17. Dezember 2007
Block 5	18. Dezember 2007	18.-21. Dezember 2007	7. Januar 2008

\* Die theoretischen Preise der neuen Produkte, die während der Tagesendverarbeitung nach 21:00 Uhr MEZ übertragen werden, bitten wir zu ignorieren.

**13. Aktualisierung der Eurex-Regelwerke**

Die aktualisierten Regelwerke sind in den Anhängen enthalten. Zusätzlich werden sie jeweils zum 10. und 17. Dezember 2007 sowie dem 7. Januar 2008 auf der Eurex-Website unter folgendem Pfad zur Verfügung gestellt:

**[www.eurexchange.com](http://www.eurexchange.com) > Dokumente > Regelwerke**

Frankfurt, 21. November 2007

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte  
und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland  
und der Eurex Zürich**

Eurex14

Stand: 10.12.2007

Seite 1

[...]

Annex A zu Ziffer 1.6 der Kontraktsspezifikationen:

[...]

Futures auf weitere Dow Jones STOXX 600® Index Komponenten	Produkt-ID	Länderkennung	Kontraktgröße	Minimale Preisveränderung**	Währung
[...]					
<u>Associated British Foods PLC</u>	<u>ABFF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Barratt Developments PLC</u>	<u>BDEF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Enterprise Inns Plc</u>	<u>ETIF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Home Retail Group PLC</u>	<u>HOMF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Intercontinental Hotels Group PLC</u>	<u>IHGF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Invensys PLC</u>	<u>ISYF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>ITV PLC</u>	<u>ITVF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Liberty International PLC</u>	<u>LIIF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Mitchells &amp; Butlers PLC</u>	<u>MABF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Persimmon PLC</u>	<u>PSNF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Punch Taverns PLC</u>	<u>PUBF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Rexam PLC</u>	<u>REXF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Severn Trent PLC</u>	<u>SVTF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Tullow Oil PLC</u>	<u>TLWF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Whitbread PLC</u>	<u>WTBF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Yell Group PLC</u>	<u>YELF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
[...]					

[...]

\*\* Die Notierung von britischen Aktien-Futures erfolgt in Pence.

**Kontraktsspezifikationen für Futures-Kontrakte  
und Optionskontrakte an der Eurex Deutschland  
und der Eurex Zürich**

Eurex14

Stand: 17.12.2007

Seite 1

[...]

Annex A zu Ziffer 1.6 der Kontraktsspezifikationen:

[...]

Futures auf weitere Dow Jones STOXX 600® Index Komponenten	Produkt- ID	Länder- kennung	Kontrakt- größe	Minimale Preisveränderung* *	Währung
[...]					
<u>Antofagasta PLC</u>	<u>ANTF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Bradford &amp; Bingley PLC</u>	<u>BBFF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>British Airways PLC</u>	<u>BAIF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Burberry Group PLC</u>	<u>BRBF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Cairn Energy Plc</u>	<u>CNEF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Drax Group PLC</u>	<u>D9FF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>DSG International PLC</u>	<u>DSGF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Firstgroup Plc</u>	<u>FGPF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>G4S PLC</u>	<u>GFSE</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>GKN PLC</u>	<u>GKNF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>ICAP PLC</u>	<u>IAPF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Investec PLC</u>	<u>INVF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Kazakhmys PLC</u>	<u>KAZF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Kelda Group Plc</u>	<u>KELF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Ladbrokes PLC</u>	<u>LADF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>LogicaCMG PLC</u>	<u>LOQF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Rentokil Initial PLC</u>	<u>RTOF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Sage Group PLC</u>	<u>SGKF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Segro PLC</u>	<u>SGRF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Tate &amp; Lyle PLC</u>	<u>TATF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
[...]					

\*\* Die Notierung von britischen Aktienfutures erfolgt in Pence.

[...]

[...]

Annex A zu Ziffer 1.6 der Kontraktspezifikationen:

[...]

Futures auf weitere Dow Jones STOXX 600® Index Komponenten	Produkt- ID	Länder- kennung	Kontrakt- größe	Minimale Preisveränderung**	Währung
[...]					
<u>Amlin PLC</u>	<u>AMLF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Bunzl PLC</u>	<u>BNZF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Carphone Warehouse Group PLC</u>	<u>CPWF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Cobham PLC</u>	<u>COBF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Daily Mail &amp; General Trust</u>	<u>DMGF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>IMI Plc</u>	<u>IMIF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Inchcape Plc</u>	<u>INCF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Informa PLC</u>	<u>INFF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>London Stock Exchange Group PLC</u>	<u>LSEF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Premier Foods PLC</u>	<u>PFDF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Provident Financial Plc</u>	<u>PFGF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Schroders PLC</u>	<u>SDRF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Tomkins Plc</u>	<u>TOMF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Travis Perkins PLC</u>	<u>TPKF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>United Business Media PLC</u>	<u>UBMF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>Vedanta Resources PLC</u>	<u>VR9F</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
<u>William Hill PLC</u>	<u>WMHF</u>	<u>GB</u>	<u>1000</u>	<u>0,01</u>	<u>GBP</u>
[...]					

\*\* Die Notierung von britischen Aktien-Futures erfolgt in Pence.

Futures auf weitere Aktien	Produkt- ID	Länder- kennung	Kontrakt- größe	Minimale Preisveränderung	Währung
<u>Polyus Gold Co</u>	<u>PLZF</u>	<u>RU</u>	<u>100</u>	<u>0,01</u>	<u>USD</u>
<u>TMK OAO</u>	<u>TMKE</u>	<u>RU</u>	<u>100</u>	<u>0,01</u>	<u>USD</u>
<u>VTB Bank OJSC</u>	<u>VTBF</u>	<u>RU</u>	<u>100</u>	<u>0,01</u>	<u>USD</u>

[...]

[...]

## 5 Kontraktpreis von OTC-Geschäften

[...]

5.2 Für Futures-Kontrakte sind die Intervalle im Sinne von 5.1 grundsätzlich wie folgt festgelegt:

5.2.1 Generell liegt für Futures-Kontrakte das Intervall zwischen den bis zum Zeitpunkt der Eingabe eines OTC-Geschäfts vorliegenden Tageshöchst- und -tiefstwerten, die an diesem Börsentag für den jeweiligen Futures-Kontrakt an den Eurex-Börsen ermittelt wurden.

Der Tageshöchstwert bestimmt sich durch den höheren Wert aus ~~ermitteltem~~ tatsächlich gehandeltem Tageshöchstwert und synthetischem Tageshöchstwert. Der synthetische Tageshöchstwert wird durch die Eurex Clearing AG aus den tatsächlich gehandelten Höchstwerten in allen Verfallmonaten und den Preisspannen zwischen den Settlementpreisen der unterschiedlichen Verfallmonate des Futures-Kontraktes bestimmt.

Der Tagestiefstwert bestimmt sich durch den niedrigeren Wert aus ~~notiertem~~ tatsächlich gehandeltem Tagestiefstwert und synthetischem Tagestiefstwert. Der synthetische Tagestiefstwert wird durch die Eurex Clearing AG aus den tatsächlich gehandelten Tagestiefstwerten in allen Verfallmonaten und den Preisspannen zwischen den Settlementpreisen der unterschiedlichen Verfallmonate des Futures-Kontraktes bestimmt.

Sofern für den Börsentag gemäß Satz 1 noch keine Settlementpreise ~~am Börsentag~~ vorliegen, werden die Settlementpreise des vorhergehenden Börsenvortages zur Bestimmung der synthetischen Tageshöchst- und Tagestiefstwerte herangezogen.

5.2.2 Für Futures-Kontrakte auf Aktienindizes und auf Aktien ergibt sich das Intervall aus den Tageshöchst- und -tiefstwerten des jeweiligen Underlyings. ~~Von Zu~~ diesen Werten ist die Differenz aus dem Settlementpreis des Futures vom vorhergehenden Handelstag und dem Vortages ~~Schlusswert/~~preis des ~~vorhergehenden Handelstages~~ des entsprechenden Underlyings ~~abzuziehen (bei negativer Differenz) oder zu addieren (bei positiver Differenz).~~ Von Zu dem ~~dadurch~~so ermittelten Höchstwert ist ein Aufschlag von 0,2% und ~~dem~~ vom Tiefstwert ein Abschlag von 0,2% bei der Berechnung des Intervalls vorzunehmen.

~~Für Futures-Kontrakte auf Aktien ist bei der Ermittlung des Intervalls nach Satz 1 und 2 der Preis der jeweiligen Aktie auf dem nachfolgend genannten Handelsplatz maßgeblich:~~

<del>Aktien von deutschen Aktiengesellschaften</del>	<del>Elektronischer Handel an der Frankfurter Wertpapierbörse</del>
<del>Aktien von belgischen, französischen, griechischen, irischen, italienischen, niederländischen, norwegischen, österreichischen, portugiesischen, schwedischen und spanischen Aktiengesellschaften</del>	<del>Präsenzhandel an der Frankfurter Wertpapierbörse</del>
<del>Aktien von schweizerischen Aktiengesellschaften</del>	<del>virt-x Exchange Limited beziehungsweise Swiss Exchange</del>
<del>Aktien von finnischen Aktiengesellschaften</del>	<del>Helsinki Stock Exchange (OMX)</del>
<del>Aktien<sup>†</sup> von russischen Aktiengesellschaften</del>	<del>London Stock Exchange (LSE)</del>

- 5.3 Für Optionskontrakte werden auf der Basis der bis zum Zeitpunkt der Eingabe eines Block-Geschäfts festgestellten Tageshöchst- und -tiefstwerte gemäß Ziffer 5.2 des jeweiligen Basiswertes und der im Optionsmarkt der Eurex-Börsen jeweils ermittelten impliziten Volatilitäten theoretische maximale und minimale Werte für den Optionspreis dieses Block-Geschäfts im Tagesverlauf ermittelt. Das sich hieraus ergebende Intervall wird an allen Handelstagen außer den Verfalltagen um die Hälfte des an seinen Eckwerten zulässigen maximalen Quote-Spreads ~~für Market-Maker~~ erweitert. An den Verfalltagen wird das Intervall um den ganzen zulässigen maximalen Quote-Spread ausgedehnt. Daraus ergibt sich die Spanne der zulässigen Optionspreise für Block-Geschäfte. Werden Options-Strategien und Options-Volatilitätsstrategien eingegeben, gilt zur Bestimmung der Strategie-Tageshöchst- und -tiefstwerte die Summe der einzelnen in der Optionsstrategie enthaltenen Options-Tageshöchst- bzw. Tiefstpreise.

[....]

<sup>†</sup> Depositary receipts (aktienvertretende Zertifikate) werden als Aktien bezeichnet.