



eurex clearing

rundschreiben 003/10

Datum: Frankfurt, 13. Januar 2010
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, alle Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book



Aktion erforderlich



Hohe Priorität

Eurex-EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 035/09, 060/09

Kontakt: Eurex Clearing Risk Operations Hotline, Tel. +49-69-211-1 24 52
 Fax +49-69-211-1 84 40, E-Mail: risk@eurexchange.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhänge:

keine

Zusammenfassung:

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex-EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter neu bestimmt worden und ab dem Batch-Lauf am 13. Januar 2010 gültig.

Das Rundschreiben enthält auch die Margin-Parameter für die im Rundschreiben 060/09 angekündigten neuen Kooperationsprodukte Phelix Base[®] und Phelix Peak[®] Futures.

Eurex-EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex-EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und ab dem Batch-Lauf am 13. Januar 2010 gültig:

Additional Margin-Parameter:

F2PE: 1,7 absolut (bleibt konstant)
FCER: 1,3 absolut (sinkt von 1,6)
F1BM: 3,7 absolut (sinkt von 4,4)
F1BQ: 3,9 absolut (bleibt konstant)
F1BY: 3,6 absolut (bleibt konstant)
F1PM: 6,8 absolut (bleibt konstant)
F1PQ: 4,7 absolut (bleibt konstant)
F1PY: 4,2 absolut (bleibt konstant)
F2CR: 1,3 absolut (sinkt von 1,6)
F2EA: 1,7 absolut (bleibt konstant)

Spread Margin-Parameter pro Kontrakt:

F2PE: EUR 300 (sinkt von EUR 400)
FCER: EUR 300 (sinkt von EUR 400)

Der Offset-Faktor für die Margin-Gruppe EMFO bleibt unverändert bei 25 Prozent.

Frankfurt, 13. Januar 2010