



# eurex clearing

## rundschreiben 045/10

**Datum:** Frankfurt, 5. Juli 2010  
**Empfänger:** Alle Clearing-Teilnehmer der Eurex Clearing AG, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, sowie Vendoren  
**Autorisiert von:** Thomas Book



**Aktion erforderlich**



**Hohe Priorität**

### Eurex / EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

**Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben:** 026/10, 038/10

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

**Zielgruppe:**

- Ü Front Office/Handel
- Ü Middle + Backoffice
- Ü IT/System Administration

**Anhänge:**

keine

**Zusammenfassung:**

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex / EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und per Batch-Lauf am **7. Juli 2010** gültig.

**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 per Batch-Lauf am 7. Juli 2010 gültig.

	<b>aktuelle Parameter</b>	<b>neue Parameter</b>
<b>Additional Margin</b>	<b>€/MWh; \$/t; €/t</b>	<b>€/MWh; \$/t; €/t</b>
F1B1	4.6	4.6
F1B2	4.6	5.3
F1B3	4.6	5.3
F1B4	4.6	5.3
F1B5	4.6	5.3
F1BM	3.7	3.7
F1BQ	2.5	2.5
F1BY	2.4	2.4
F1P1	7.2	6.5
F1P2	7.2	6.5
F1P3	7.2	6.5
F1P4	7.2	6.5
F1P5	7.2	6.5
F1PM	6	6
F1PQ	3.2	3.2
F1PY	3.1	3.1
F2CR	1.3	1
F2EA	1.6	1.2
F2PE	1.6	1.6
FCER	1.3	1.3
FEUA	1.6	1.6
<b>Spread Margin</b>	<b>in € pro Kontrakt</b>	<b>in € pro Kontrakt</b>
FEUA	300	300
F2PE	300	300
FCER	300	300

Der Offset-Faktor für die Margin-Gruppe EMFO (Emissions Futures & Options) bleibt unverändert bei 25 Prozent.

Frankfurt, 5. Juli 2010