clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 007/10

Datum: Frankfurt, 29. Januar 2010

Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren

Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Aktion erforderlich** ⚠ **Hohe Priorität**

Eurex-EEX-Kooperation: Update der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex Clearing Rundschreiben: 018/09, 048/09, 060/09, 03/10,

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
- 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 **3. Februar 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 Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 24 52
F +49-69-211-1 84 40
risk@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender),
Jürg Spillmann, Thomas Book,
Gary Katz, Thomas Lenz,
Michael Peters, Peter Reitz

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex-EEX-Kooperation: Update 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 3. Februar 2010 gültig.

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

	Aktueller Parameter	Neuer Parameter
Additional Margin	**€/MWh; $/t; €/t**	**€/MWh; $/t; €/t**
F1BM	3,70	3,70
F1BQ	3,90	3,90
F1BY	3,60	3,00
F1PM	6,80	6,00
F1PQ	4,70	4,70
F1PY	4,20	3,60
F2CR	1,30	1,30
F2EA	1,70	1,70
F2PE	1,70	1,70
FCER	1,30	1,30
Spread Margin	**in EUR pro Kontrakt**	**in EUR pro Kontrakt**
F2PE	300	300,00
FCER	300	300,00

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

Frankfurt, 29. Januar 2010