clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 063/10

Datum: Frankfurt, 8. September 2010

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

Autorisiert von: Peter Reitz

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

Eurex / EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 003/10, 007/10, 026/10, 045/10, 57/10

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

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 **8. September 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 8. September 2010 gültig:

Produkt	Aktueller Parameter	Neuer Parameter
Additional Margin	**€/MWh; $/t; €/t**	**€/MWh; $/t; €/t**
F1BM	3,7	3,7
F1BQ	2,5	2,5
F1BY	2,4	2,4
F1PM	6,0	6,0
F1PQ	3,2	3,2
F1PY	3,0	3,0
F2CR	1,0	1,0
F2EA	1,2	1,2
F2PE	1,2	1,2
FCER	1,0	1,0
FEUA	1,6	1,1
F1B1	5,3	4,7
F1B2	5,3	4,7
F1B3	5,3	4,7
F1B4	5,3	4,7
F1B5	5,3	4,7
F1P1	5,7	5,7
F1P2	5,7	5,7
F1P3	5,7	5,7
F1P4	5,7	5,7
F1P5	5,7	5,7
Spread Margin	**in € pro Kontrakt**	**in € pro Kontrakt**
F2PE	300,00	300,00
FCER	300,00	300,00
FEUA	300,00	300,00

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

Frankfurt, 8. September 2010