clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 035/09

Datum: Frankfurt, 8. Juli 2009
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

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

Eurex-EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter zum 10. Juli 2009

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 026/09

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:	**Anhänge:**
Ü Front Office/Handel Ü Middle + Backoffice Ü IT/System Administration	keine

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex-EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und ab Batch-Lauf am 10. Juli 2009 gültig:

Additional Margin-Parameter:

F2PE: 1,7 absolut (sinkt von 2,2 absolut)
FCER: 1,6 absolut (konstant)

Spread Margin-Parameter pro Kontrakt:

F2PE: EUR 400 (konstant)
FCER: EUR 400 (konstant)

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

Eurex Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
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