

e u r e x *rundschreiben 66/99*

An: An die Mitglieder und Vendoren der Eurex

Datum: Frankfurt, 20. Juli 1999

Anpassung der Marginparameter

Sehr geehrte Damen und Herren,

beigefügt ist eine Aufstellung der ab dem 27. Juli 1999 gültigen Marginparameter der Eurex.

Eventuelle Rückfragen hierzu beantwortet Ihnen gerne unser Clearing Help-desk unter +49 (0)69-2101-1250.

Mit freundlichen Grüßen


Dr. Jörg Franke


Hartmut Klein

Eurex Marginklassen, Margingruppen, und Marginparameter ab 27.07.99

Margin Klasse	Produkte in dieser Klasse	Bisherige Parameter	Neue Parameter ab 27.07.99
FGBX	FGBX spread rates	3,0 Punkte (EURO 3.000,--) EURO 180,-- back month EURO 260,-- spot month	keine Änderung
FGBL	FGBL OGBL spread rates	1,6 Punkte (EURO 1.600,--) EURO 160,-- back month EURO 240,-- spot month	keine Änderung
FGBM	FGBM OGBM spread rates	0,9 Punkte (EURO 900,--) EURO 140,-- back month EURO 200,-- spot month	0,7 Punkte (EURO 700 ,--) EURO 140,-- back month EURO 200,-- spot month
FGBS	FGBS OGBS spread rates	0,4 Punkte (EURO 400,--) EURO 120,-- back month EURO 140,-- spot month	keine Änderung

Margin Klasse	Produkte in dieser Klasse	Bisherige Parameter	Neue Parameter ab 27.07.99
FEU1	FEU1 spread rates	0,25 Punkte (EURO 625,--) EURO 300,-- back month EURO 300,-- spot month	keine Änderung
LIB3	LIB3 spread rates	0,30 Punkte (DM 750,--) DM 300,-- back month DM 300,-- spot month	0,28 Punkte (DM 700,--) DM 300,-- back month DM 300,-- spot month
FEU3	FEU3 spread rates	0,30 Punkte (EURO 750,--) EURO 300,-- back month EURO 300,-- spot month	0,28 Punkte (EURO 700,--) EURO 300,-- back month EURO 300,-- spot month
OEU3	OEU3	0,30 Punkte	0,28 Punkte
FLI3	FLI3 spread rates	0,30 Punkte (EURO 750,--) EURO 300,-- back month EURO 300,-- spot month	0,28 Punkte (EURO 700,--) EURO 300,-- back month EURO 300,-- spot month

Margin Klasse	Produkte in dieser Klasse	Bisherige Parameter	Neue Parameter ab 27.07.99
DAX	FDAX ODAX spread rates	340 Punkte (EURO 8.500,--) EURO 190,-- back month EURO 190,-- spot month	keine Änderung
FDAY	Odd Lot FDAY/ODAY spread rates	340 Punkte EURO 4,-- Back month EURO 4,-- Spot month	keine Änderung
MDAX	FMDX spread rates	180 Punkte (EURO 900,--) EURO 40,-- Back month EURO 40,-- Spot month	keine Änderung
FMDY	Odd Lot FMDY spread rates	180 Punkte EURO 1,-- back month EURO 1,-- spot month	keine Änderung
EUSX	FESX OESX spread rates	250 Punkte (EURO 2.500,--) EURO 70,-- back month EURO 70,-- spot month	keine Änderung
STXX	FSTX OSTX spread rates	250 Punkte (EURO 2.500,--) EURO 70,-- back month EURO 70,-- spot month	keine Änderung

Margin Klasse	Produkte in dieser Klasse	Alt	Neu
ADS	ADS	10 %	keine Änderung
ALV	ALV	10 %	keine Änderung
BAS	BAS	9 %	keine Änderung
BAY	BAY	9 %	8 %
BMW	BMW	11 %	keine Änderung
CBK	CBK	9 %	keine Änderung
DBK	DBK	10 %	keine Änderung
DCX	DCX	10 %	9 %
DHA	DHA	10 %	keine Änderung
DRB	DRB	10 %	keine Änderung
DTE	DTE	10 %	keine Änderung
HEN3	HEN3	10%	keine Änderung
HOE	HOE	11 %	keine Änderung
HVM	HVM	11 %	keine Änderung
KAR	KAR	9 %	10 %
LHA	LHA	10 %	keine Änderung
LIN	LIN	10 %	keine Änderung
MAN	MAN	9 %	keine Änderung
MEO	MEO	10 %	9 %
MMN	MMN	10 %	keine Änderung
MUV2	MUV2	10 %	keine Änderung
PRS	PRS	8 %	10 %
RWE	RWE	9 %	10 %
SAP3	SAP3	12 %	14 %
SCH	SCH	8 %	keine Änderung
SIE	SIE	10 %	11 %
TKA	TKA	9 %	keine Änderung
VEB	VEB	9 %	keine Änderung
VIA	VIA	9 %	keine Änderung
VOW	VOW	11 %	keine Änderung

Margin Klasse	Produkte in dieser Klasse	Bisherige Parameter	Neue Parameter ab 27.07.99
CONF Fut on Swiss Govt. Bond	CONF OCNF spread rates	1,5 Punkte (CHF 1.500,--) CHF 250,-- back month CHF 500,-- spot month	keine Änderung
SMI	FSMI SMI OSMI spread rates	400 Punkte (CHF 4.000,--) CHF 100,-- back month CHF 100,-- spot month	keine Änderung

Margin Klasse	Produkte in dieser Klasse	Alt	Neu
ABBN	ABBN	11 %	10 %
ALUN	ALUN	10 %	9 %
CIBN	CIBN	10 %	keine Änderung
CLN	CLN	10 %	9 %
CSGN	CSGN	11 %	10 %
HOL	HOL	9 %	keine Änderung
NESN	NESN	8 %	7 %
NOVN	NOVN	8 %	7 %
RAN	RAN	11 %	9 %
ROG	ROG	8 %	7 %
RUKN	RUKN	8 %	keine Änderung
SCMN	SCMN	9 %	8 %
SRN	SRN	8 %	keine Änderung
SUN	SUN	11 %	keine Änderung
UBSN	UBSN, SBVN	11 %	10 %
UHRN	UHRN	7 %	keine Änderung
ZUAN	ZUAN	9 %	keine Änderung

Margingruppen	Marginklassen	Offset Faktor
BUBO	FGBX, FGBL, FGBM, FGBS	0 %
DMIX	DAX, MDAX, SMI, FDAY, FMDY	0 %
STOX	EUSX, STXX	0 %
LIBO	LIB3, FLI3, FEU1, FEU3, OEU3	25 %