



eurex clearing

rundschreiben 191/08

Datum: Frankfurt, 8. August 2008
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, alle Clearing-Teilnehmer der Eurex Clearing AG sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book



Aktion erforderlich



Hohe Priorität

Eurex und EEX: Kooperation im Emissionshandel - Update der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 205/07, 236/07, 252/07, 26/08, 28/08, 119/08, 167/08

Kontakt: Eurex Risk Operations, Tel. +49-69-211-1 24 52, Fax +49-69-211-1 24 52,
E-Mail: risk@eurexexchange.com

Zielgruppe:

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

Anhänge:

keine

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex-EEX Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und per Batch-Lauf am **11. August 2008** gültig:

Additional Margin Parameter:

F2PE: 2,3 absolut (sinkt von 3,0 absolut)

FCER: 2,0 absolut (steigt von 1,4 absolut)

Spread Margin Parameter pro Kontrakt:

F2PE: 400 € (konstant)

FCER: 600 € (steigt von 500€)

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

Bei Fragen wenden Sie sich bitte an Risk Operations unter Tel. +49 (0)69 - 211-1 24 52.