



eurex clearing

rundschreiben 278/08

Datum: Frankfurt, 14. November 2008
Empfänger: Alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich, alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Lenz



Aktion erforderlich



Hohe Priorität

Eurex-EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 026/08, 028/08, 119/08, 167/08, 248/08

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

Zielgruppe:

- Middle + Backoffice
- IT/System Administration
- Revision/Security Coordination

Anhänge:

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 17. November 2008 gültig:

Additional Margin-Parameter:

F2PE: 2,6 absolut (konstant)
 FCER: 1,9 absolut (steigt von 1,6 absolut)

Spread Margin-Parameter pro Kontrakt:

F2PE: EUR 400 (konstant)
 FCER: EUR 800 (steigt von EUR 600)

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

