clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 069/11

Datum: 6. September 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Jürg Spillmann

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

Eurex/EEX-Kooperation: Aktualisierung der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 054/11

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

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 2011** gültig.

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 24 52
F +49-69-211-1 84 40
risk@
eurexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender), Jürg Spillmann, Thomas Book, Gary Katz, Michael Peters, Peter Reitz

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex/EEX-Kooperation: Aktualisierung 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 2011 gültig:

Margin-Klasse	aktueller Parameter	neuer Parameter
	€/MWh; $/t; €/t	€/MWh; $/t; €/t
F1B1	6.90	6.90
F1B2	6.90	6.90
F1B3	6.90	6.90
F1B4	6.90	6.90
F1B5	6.90	6.90
F1BM	4.20	4.20
F1BQ	3.20	3.20
F1BY	2.70	2.70
F1OM	4.60	3.90
F1OQ	3.60	3.60
F1OY	2.80	2.80
F1P1	8.40	8.40
F1P2	8.40	8.40
F1P3	8.40	8.40
F1P4	8.40	8.40
F1P5	8.40	8.40
F1PM	5.20	5.20
F1PQ	3.80	3.80
F1PY	3.00	3.00
F2CR	1.00	1.00
F2EA	2.20	1.60
F2PE	2.20	1.60
FCER	1.00	1.00
FEUA	2.20	1.60
FT2M	6.30	6.30
Spread Margin	**€/Kontrakt**	**€/Kontrakt**
F2PE	300	300
FCER	300	300
FEUA	300	300

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

6. September 2011