clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 059/12

Datum: 6. Juli 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

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

Eurex/EEX-Kooperation: Aktualisierung der Margin-Parameter per Tagesendverarbeitung am 10. Juli 2012

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 044/12

Kontakt: Eurex Clearing Risk Operations Hotline, Tel. +49-69-211-1 24 52,
Fax +49-69-211-1 84 40 oder E-Mail: risk@eurexclearing.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 Tagesendverarbeitung am **10. Juli 2012** 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@
eurexclearing.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Reto Francioni

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 per Tagesendverarbeitung am 10. Juli 2012

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex/EEX-Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und per Tagesendverarbeitung am 10. Juli 2012 gültig:

Product	Current Margin Parameter	New Margin Parameter
F1B1	6.7	6.7
F1B2	6.7	6.7
F1B3	6.7	6.7
F1B4	6.7	6.7
F1B5	6.7	6.7
F1BM	4.20	4.20
F1BQ	2.50	2.50
F1BY	2.00	2.00
F1OM	3.7	3.7
F1OQ	3	**2.30**
F1OY	2.3	2.3
F1P1	9.1	9.1
F1P2	9.1	9.1
F1P3	9.1	9.1
F1P4	9.1	9.1
F1P5	9.1	9.1
F1PM	5.20	5.20
F1PQ	2.90	2.90
F1PY	2.10	2.10
F2CR	0.8	0.8
F2EA	1.4	1.4
F2PE	1.40	1.40
F7B1	10.5	10.5
F7B2	10.5	10.5
F7B3	10.5	10.5
F7B4	10.5	10.5
F7B5	10.5	10.5
F7P1	12.9	12.9
F7P2	12.9	12.9
F7P3	12.9	12.9
F7P4	12.9	12.9
F7P5	12.9	12.9
FCER	0.8	0.8
FEUA	1.40	1.40
FT2M	4.80	4.80
FT2Q	5.20	5.20
FT2Y	6.50	6.50
FT4M	5.00	5.00
FT4Q	5.30	5.30
FT4Y	6.9	6.9
G0BM	1.70	1.70
G0BQ	1.70	1.7

G0BS	1.60	**1.30**
G0BY	1.20	1.08
G2BM	1.80	1.67
G2BQ	1.60	1.32
G2BY	1.30	1.10
F7BM	5.60	5.60
F7PM	6.50	6.50
F7BQ	3.40	**2.80**
F7PQ	3.80	3.8
F7BY	2.20	2.2
F7PY	2.7	**2.20**
Spread Margin	**Current Margin Parameter**	**New Margin Parameter**
F2PE	0.30	0.30
FCER	0.30	0.30
F2CR	0.30	0.30
F2EA	0.30	0.30
FEUA	0.30	0.30

6. Juli 2012