clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 078/12

Datum: 19. September 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Dr. Thomas Book

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

Eurex/EEX-Kooperation: Aktualisierung der Margin-Parameter per Tagesendverarbeitung am 24. September 2012

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 063/12

Kontakt: Eurex Clearing Risk Operations, T +49-69-211-1 24 52, F +49-69-211-1 84 40, risk@eurexclearing.com

Zielgruppe:	**Anhänge:**
Ü Front Office/Handel Ü Middle + Backoffice Ü IT/System Administration	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 **24. September 2012** gültig.

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

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
memberservices@
eurexclearing.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Hugo Bänziger

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender),
Jürg Spillmann, Dr. 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 24. September 2012

Im Zuge der Kooperation sind für die Eurex/EEX-Emissions-Kooperationsprodukte die Margin-Parameter wie folgt neu bestimmt worden und per Tagesendverarbeitung am 24. September 2012 gültig:

Product	Current Margin Parameter	New Margin Parameter
F1B1	6.7	**6.3**
F1B2	6.7	**6.3**
F1B3	6.7	**6.3**
F1B4	6.7	**6.3**
F1B5	6.7	**6.3**
F1BM	4.2	**3.4**
F1BQ	2.5	**2.3**
F1BY	2	**1.6**
F1OM	3.7	**3.6**
F1OQ	2.3	**2.4**
F1OY	2.3	**1.8**
F1P1	9.1	**8.7**
F1P2	9.1	**8.7**
F1P3	9.1	**8.7**
F1P4	9.1	**8.7**
F1P5	9.1	**8.7**
F1PM	5.2	**4.2**
F1PQ	2.9	2.9
F1PY	2.1	**1.7**
F7B1	8.1	**8.2**
F7B2	8.1	**8.2**
F7B3	8.1	**8.2**
F7B4	8.1	**8.2**
F7B5	8.1	**8.2**
F7BM	5.6	**5**
F7BQ	2.8	**3.1**
F7BY	2.2	**1.9**
F7P1	11.3	**12.1**
F7P2	11.3	**12.1**
F7P3	11.3	**12.1**
F7P4	11.3	**12.1**
F7P5	11.3	**12.1**
F7PM	6.5	6.5
F7PQ	3.8	**4.5**
F7PY	2.2	**2.5**
FCER	0.6	**0.4**
FEAA	1.6	**1.3**
FERU	1.1	**0.4**
FEUA	1.1	**1.3**

Product	Current Margin Parameter	New Margin Parameter
FT2M	4.8	**4.1**
FT2Q	5.2	**4.3**
FT2Y	5.9	**4.3**
FT4M	5	**4.4**
FT4Q	6.3	**4.4**
FT4Y	6.3	**4.2**
G0BM	1.7	**1.8**
G0BQ	1.7	1.7
G0BS	1.3	**1.5**
G0BY	1.2	**1.1**
G2BM	1.8	1.8
G2BQ	1.6	1.6
G2BS	1.3	**1.2**
G2BY	1.3	**1.1**

19. September 2012