clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 028/11

Datum: 29. März 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-Rundschreiben: 063/10, 100/10, 003/11, 007/11, 018/11

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 **1. April 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 1. April 2011 gültig:

Produkt	aktueller Parameter	neuer Parameter
Additional Margin	**€/MWh; $/t; €/t**	**€/MWh; $/t; €/t**
F1B1	10.5	6.9
F1B2	10.5	6.9
F1B3	10.5	6.9
F1B4	10.5	6.9
F1B5	10.5	6.9
F1BM	3.7	4.2
F1BQ	4	4
F1BY	3.7	2.7
F1OM	3.8	4.6
F1OQ	2.4	3.6
F1OY	2.8	2.8
F1P1	9	8.4
F1P2	9	8.4
F1P3	9	8.4
F1P4	9	8.4
F1P5	9	8.4
F1PM	5.2	5.2
F1PQ	5.5	4.5
F1PY	4.4	3.4
F2CR	0.8	0.9
F2EA	1.1	1.1
F2PE	1.1	1.1
FCER	0.8	0.9
FEUA	1.1	1.1
Spread margin	**in € pro Kontrakt**	**in € pro Kontrakt**
FEUA	300	300
F2PE	300	300
FCER	300	300

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

29. März 2011