clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 003/11

Datum: 11. Januar 2011
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

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 063/10, 100/10

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 **13. Januar 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 13. Januar 2011 gültig:

Produkt	aktueller Parameter	neuer Parameter
Additional Margin	**€/MWh; $/t; €/t**	**€/MWh; $/t; €/t**
F1B1	7.5	7.5
F1B2	7.5	7.5
F1B3	7.5	7.5
F1B4	7.5	7.5
F1B5	7.5	7.5
F1BM	3.7	3.7
F1BQ	2.5	2.5
F1BY	2.4	2.4
F1OM	3.2	3.2
F1OQ	2.4	2.4
F1OY	1.9	1.9
F1P1	9.5	12.4
F1P2	9.5	12.4
F1P3	9.5	12.4
F1P4	9.5	12.4
F1P5	9.5	12.4
F1PM	4.5	4.5
F1PQ	3.7	3.7
F1PY	3.2	3.4
F2CR	1	1
F2EA	1.2	1.2
F2PE	1.2	1.2
FCER	1	1
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.

11. Januar 2011