clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 026/10

Datum: Frankfurt, 3. Mai 2010
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG, alle Handelsteilnehmer der Eurex Deutschland und Eurex Zürich sowie Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

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

Eurex / EEX-Kooperation: Anpassung der Margin-Parameter

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 018/09, 048/09, 060/09, 003/10, 007/10

Kontakt: Eurex Clearing Risk Operations Hotline, Tel. +49-69-211-1 24 52, Fax +49-69-211-1 84 40, 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 **4. Mai 2010** gültig.

Eurex Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
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: Anpassung 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 4. Mai 2010 gültig.

	aktueller Parameter	neuer Parameter
Additional Margin	**€/MWh; $/t; €/t**	**€/MWh; $/t; €/t**
F1BM	3,70	3,70
F1BQ	3,10	2,5
F1BY	2,4	2,4
F1PM	6,00	6,00
F1PQ	3,80	3,2
F1PY	3,00	3,00
F2CR	1,30	1,30
F2EA	1,40	1,60
F2PE	1,40	1,60
FCER	1,30	1,30
F1B1	7,5	4,20
F1B2	7,5	4,20
F1B3	7,5	4,20
F1B4	7,5	4,20
F1B5	7,5	4,20
F1P1	9,5	7,20
F1P2	9,5	7,20
F1P3	9,5	7,20
F1P4	9,5	7,20
F1P5	9,5	7,20
Spread Margin	**in € pro Kontrakt**	**in € pro Kontrakt**
F2PE	300	300
FCER	300	300

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

Frankfurt, 3. Mai 2010