clear to trade

# e u r e x  c l e a r i n g
# *rundschreiben 063/12*

**Datum:** 9. August 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 10. August 2012

**Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben:** 059/12

**Kontakt:** Eurex Clearing Risk Operations, Tel. +49-69-211-1 24 52, Fax +49-69-211-1 84 40, E-Mail: risk@eurexclearing.com

| **Zielgruppe:** | **Anhänge:** |
|---|---|
| Ü Front Office/Handel<br>Ü Middle + Backoffice<br>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 **10. August 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. Reto Francioni

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 10. August 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. August 2012 gültig:

| Product | Current Margin Parameter | New Margin Parameter |
|---|---|---|
| **F1B1** | 6.70 | 6.70 |
| **F1B2** | 6.70 | 6.70 |
| **F1B3** | 6.70 | 6.70 |
| **F1B4** | 6.70 | 6.70 |
| **F1B5** | 6.70 | 6.70 |
| **F1BM** | 4.20 | 4.20 |
| **F1BQ** | 2.50 | 2.50 |
| **F1BY** | 2.00 | 2.00 |
| **F1OM** | 3.70 | 3.70 |
| **F1OQ** | 2.30 | 2.30 |
| **F1OY** | 2.30 | 2.30 |
| **F1P1** | 9.10 | 9.10 |
| **F1P2** | 9.10 | 9.10 |
| **F1P3** | 9.10 | 9.10 |
| **F1P4** | 9.10 | 9.10 |
| **F1P5** | 9.10 | 9.10 |
| **F1PM** | 5.20 | 5.20 |
| **F1PQ** | 2.90 | 2.90 |
| **F1PY** | 2.10 | 2.10 |
| **F2CR** | 0.80 | **0.60** |
| **F2EA** | 1.40 | **1.10** |
| **F2PE** | 1.40 | **1.10** |
| **F7B1** | 10.50 | **8.10** |
| **F7B2** | 10.50 | **8.10** |
| **F7B3** | 10.50 | **8.10** |
| **F7B4** | 10.50 | **8.10** |
| **F7B5** | 10.50 | **8.10** |
| **F7P1** | 12.90 | **11.30** |
| **F7P2** | 12.90 | **11.30** |
| **F7P3** | 12.90 | **11.30** |
| **F7P4** | 12.90 | **11.30** |
| **F7P5** | 12.90 | **11.30** |
| **FCER** | 0.80 | **0.60** |
| **FEUA** | 1.40 | **1.10** |
| **FT2M** | 4.80 | 4.80 |
| **FT2Q** | 5.20 | 5.20 |
| **FT2Y** | 6.50 | **5.90** |
| **FT4M** | 5.00 | 5.00 |
| **FT4Q** | 5.30 | **6.30** |
| **FT4Y** | 6.90 | 6.90 |
| **G0BM** | 1.70 | 1.70 |
| **G0BQ** | 1.70 | 1.70 |

| Product | Current Margin Parameter | New Margin Parameter |
|---|---|---|
| **G0BS** | 1.30 | 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** | 2.80 | 2.80 |
| **F7PQ** | 3.80 | 3.80 |
| **F7BY** | 2.20 | 2.20 |
| **F7PY** | 2.20 | 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 |

9. August 2012