clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 066/11

Datum: 24. August 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ Aktion erforderlich

Margins: Anpassung der Zusammensetzung und Offset-Faktoren von sektorenbasierten Margin-Gruppen

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 043/11

Kontakt: Risk Operations, Tel. +49-69-211-1 24 52, E-Mail: risk@eurexchange.com

Zielgruppe:

- Front Office / Handel
- Middle & Back Office
- Revision / Security Coordination

Anhang:

Aktualisierte Übersicht der Eurex-Margin-Gruppen und der Offset-Faktoren in der Produktionsumgebung

Zum **29. August 2011** nach der Tagesendverarbeitung erfolgt eine Anpassung der sektorenbasierten Margin-Gruppen.

Die Anlage enthält eine Übersicht über die mit Wirkung zum 29. August 2011 nach der Tagesend-verarbeitung gültige Zusammensetzung der Margin-Gruppen, die jeweiligen zugehörigen Margin-Klassen und die Offset-Faktoren der einzelnen Margin-Gruppen in der Produktionsumgebung.

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

Overview of Eurex margin groups and offset factors in production environment, effective August 29, 2011

MARGIN_GROUP_NAME	MARGIN_GROUP_CODE	OFFSET	MARGIN_CLASS_CODES																										
Automobiles & Parts	STXA	0%	BM3F	BMW	CON	DAI	ESA	GKN	MCH	NRE	PEU	PIL	RHM	RNL	STA	VO3F	VOW	VSA											
Banks	STXB	0%	BAKN	BCA	BDS	BNP	BOY	BPD	BPE	BPM	BSD2	CRI5	CVA	DBK	DXB	EBO	ESB	FO4	IES5	KDB	ME9	MPI	OKB	POP	RBS	SGE	STB	UBSN	XCA
Chemicals	STXC	0%	AIR	BAS	BAY	ESC	LIN	LXS	SDF	STC																			
Oil & Gas	STXE	0%	BGF	BP	ENT	ESE	GDG	REP	ROSB	ROY	SPE	STE	THP	TOT															
Financial Services	STXF	0%	BAEB	BAER	EAI	ESF	EUQ	INV	MFX	PAR	STF																		
Industrial Goods & Services	STXG	0%	ABBN	ADEN	AOM	ESG	G1A	KC4	LRC	NXS	PRY	RSH	SIE	SND	STG	TKA	TPK	WLY											
Insurance	STXI	0%	AEN	ALV	ASG	AV	AXA	BALN	CMA	ESI	HNR1	INN	LGE	MUN	MUV2	OML	PRU	SLHN	SMPA	STI	ZURN								
Travel & Leisure	STXL	0%	ACR	AFR	BAI	CCL	ESV	IHG	LHA	STV																			
Media	STXM	0%	DCS	ESM	INF	MMT	PU4	STM	SWS	UBM	VVU	WOS	WPP																
Construction & Materials	STXN	0%	BYG	CIL	EF3	ESN	GBF	GEBN	GOB	HEI	HOLN	KBW	SKA	SQU	STN	UCM													
Food & Beverage	STXO	0%	BSN	DGE	ESO	HNK	ITK	PER	STO																				
Retail	STXR	0%	CAJ	CAR	ESR	MEO	STR																						
Basic Resources	STXS	0%	AAL	ATO	BLT	ENUR	ERA	ERS	ESS	KAZ	LMI	NDAF	NHD	NKF	RIO	RKK	STS	VAS	VR9	XTA									
Telecommunications	STXT	0%	DTE	EST	FTE	STT	TNE5																						
Utilities	STXU	0%	E2F	ENL5	EOA	ESU	GZF	IBE	RW3F	RWE	STU																		
Real Estate	STXV	0%	BLN	HMS	LAN	LIFN	SEL	STL	UBL	WER																			
Technology	STXY	0%	CGE	CGM	ESY	IFX	SAP	STY																					
Fixed Income Products	BUBO	43%	FGBL	FGBM	FGBS	FGBX																							
Non-Sector Index Products	DMIX	100%	2LA	2MI	2SM	600	DAX	DDAX	EDV	EUN2	EUSX	EXS1	FOX	GII	GTD	MDAX	SLI	SMI	SMIM	STXX									
Health Care	STXH	50%	ESH	NOVN	ROG	SNW	STH																						
Personal & Household Goods	STXP	50%	CFR	DIO	ESZ	GRB	LUX	MOH	STZ	UHR	UHRN																		
Money Market Products	LIBO	100%	FEO1	FEU3																									
Fixed Income Products - CONF	SWIS	100%	CONF																										
Volatility Index Products	VOLA	100%	VSX1																										