clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 099/11

Datum: 6. Dezember 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: 066/11

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Front Office / Handel ➲ Middle & Back Office ➲ Revision / Security Coordination	Aktualisierte Übersicht der Eurex-Margin-Gruppen und der Offset-Faktoren in der Produktionsumgebung

Zum **12. Dezember 2011** nach der Tagesendverarbeitung erfolgt eine Anpassung der sektorenbasierten Margin-Gruppen.

Die Anlage enthält eine Übersicht über die mit Wirkung zum 12. Dezember 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

Attachment to Eurex Clearing Circular 099/11

Updated overview of Eurex margin groups and offset factors in production environment

MARGIN_GROUP_NAME	MARGIN_GROUP_CODE	OFFSET	MARGIN_CLASS_CODES																											
Automobiles & Parts	STXA	0%	BM3F	BMW	CON	DAI	ESA	FIA5	GKN	MCH	NRE	PEU	PIL	POR3	RNL	STA	VO3F	VOW	VSA											
Banks	STXB	0%	BAR	BNP	BOY	BPD	BSD2	CBK	CRI5	CSGN	DBK	ESB	FO4	IES5	KDB	LLOY	NBP	NDB	OKB	POP	RBS	SGE	STB	UBSN	XCA					
Chemicals	STXC	0%	AIR	AKU	BAS	BAY	CLN	DSM	ESC	JMA	LIN	LXS	NVJN	SDF	SOL	STC	SYNN													
Oil & Gas	STXE	0%	ENT	ESE	F3D	GDG	P2F	REP	ROSB	SBMO	SPE	STE	THP	TOT																
Financial Services	STXF	0%	BAEB	BAER	CL6	CSV	EAI	ESF	EUQ	III	IIL	INV	MFX	PAR	SDRF	STF														
Industrial Goods & Services	STXG	0%	ABBN	ADEN	AOM	C1C	DPW	ESG	FIN	FRA	G1A	IMI	KC4	KNI	LRC	NXS	PRY	RSH	SIE	STG	SUN	TKA	TPK	TUN	VAC	VLM	W7L	WLY		
Health Care	STXH	0%	AZN	ESH	NOVN	ROG	SNW	STH																						
Insurance	STXI	0%	AEN	ALV	ASG	AV	AXA	BALN	CMA	ESI	HELN	HNR1	INN	LGE	MUN	MUV2	OML	PRU	RSA	RUKN	SDR	SLF	SLHN	SMPA	STI	ZURN				
Travel & Leisure	STXL	0%	ACR	AFR	BAI	CCL	ESV	IHG	LHA	STV	TUI																			
Media	STXM	0%	DCS	DMG	ESM	HAV	INF	MDS5	MMT	PSM	PU4	REL	STM	SWS	UBM	VVU	WOS	WPP												
Construction & Materials	STXN	0%	ASS	BGP	CIL	CRG	EF3	ESN	GBF	GEBN	GOB	HEI	HOLN	HOT	KBW	NIH	OCI1	SIK	SKA	SQU	STN	UCM	WIE							
Food & Beverage	STXO	0%	BSN	ESO	HEH	HNK	STO	ULV	UNI																					
Personal & Household Goods	STXP	0%	ADS	CFR	DIO	ESZ	GRB	HEN3	HESF	LOR	LUX	MOH	PHI1	STZ	UHR	UHRN														
Retail	STXR	0%	CAJ	CAR	ESR	KEK	MEO	PPX	STR																					
Basic Resources	STXS	0%	AAL	ACE	ATO	BLT	ENUR	ERA	ERS	ESS	ISP	KAZ	KCO	LMI	NDAF	NHD	NKF	OUT	RIO	RKK	RPL	STS	SZG	TEN	VAS	VR9	XTA		
Telecommunications	STXT	0%	BX7	DTE	EIA	EST	FTE	STT	TLSN	TNE5	TQI																			
Utilities	STXU	0%	E2F	EAM	EG4	ENL5	EOA	ESU	FOT	GAN	GZF	IBE	RE2	RW3F	RWE	SNF	STU	VVD												
Real Estate	STXV	0%	BLN	HMS	IMO	LAN	LIFN	LIIG	SEL	STL	UBL	WER																		
Technology	STXY	0%	AXI	CGM	ESY	IFX	ISY	SAP	SGM	STY	TTEB	UTDI	WIN																	
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	GTI	MDAX	SLI	SMI	SMIM	STXX	TDX								
Money Market Products	LIBO	100%	FEO1	FEU3																										
Fixed Income Products - CONF	SWIS	100%	CONF																											
Volatility Index Products	VOLA	100%	VSX1																											