



eurex clearing

rundschreiben 176/14

Datum: 2. Dezember 2014
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendors
Autorisiert von: Thomas Laux

 **Aktion erforderlich**

Margins: Anpassung der Zusammensetzung und Offset-Faktoren von sektorenbasierten Margin-Gruppen zum 5. Dezember 2014

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 107/14

Kontakt: Risk Control, T +49-69-211-1 24 52, risk@eurexclearing.com

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhang:

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

Zum **5. Dezember 2014** nach der Tagesendverarbeitung erfolgt eine Anpassung der sektorenbasierten Margin-Gruppen.

Die Anlage enthält eine Übersicht über die mit Wirkung zum 5. Dezember 2014 nach der Tagesendverarbeitung gültige Zusammensetzung der Margin-Gruppen, die jeweiligen zugehörigen Margin-Klassen und die Offset-Faktoren der einzelnen Margin-Gruppen in der Produktionsumgebung.

MARGIN_GROUP_NAME	MARGIN_GROUP	OFFSET	MARGIN_CLASS_CODES																	
Fixed Income Products	BUBO	0%	FGBL	FGBM	FGBS	FOAM														
Non-Sector Index Products	DMIX	100%	2LA	2MI	2SM	600	DAX	DDAX	EUSX	FOX	LCXE	MCXE	MDAX	SCXE	SLI	SMI	SMIM	STXX	SXXE	TDX
Italian Fixed Income Products	ITAL	43%	BTP	FBTM	FBTS															
Money Market Products	LIBO	43%	FEO1																	
Automobiles & Parts	STXA	0%	BMW	DAI	POR3	RNL														
Banks	STXB	0%	BNP	BOY	BPE	BSD2	CRI5	ESB	IES5	STB	XCA									
Chemicals	STXC	0%	AIR	BAS	BNR	EMC	ESC	STC												
Oil & Gas	STXE	50%	ENT	ESE	REP	ROY	STE	TOT												
Financial Services	STXF	50%	ACK	ESF	STF															
Industrial Goods & Services	STXG	0%	AAI	ESG	LEOF	SND	STG													
Health Care	STXH	0%	ROG	STH																
Insurance	STXI	0%	ALV	ASG	AXA	ESI	STI													
Travel & Leisure	STXL	50%	ESV	RY4H	STV															
Media	STXM	0%	ELV	ESM	STM	WOS														
Construction & Materials	STXN	0%	CIL	ESN	GOB	STN														
Food & Beverage	STXO	50%	ESO	STO	ULV	UNI														
Personal & Household Goods	STXP	0%	DIO	ESZ	MOH	STZ														
Retail	STXR	0%	CAJ	ESR	MEO	STR														
Basic Resources	STXS	0%	AAL	BLT	ESS	GLI	RIO	STS												
Telecommunications	STXT	0%	EST	FTE	STT															
Utilities	STXU	0%	ESU	GZF	IBE	RWE	STU													
Real Estate	STXV	0%	DEQF	FDR	ICAD	LIFN	SEL	STL	UBL	WER										
Fixed Income Products - CONF	SWIS	43%	CONF																	
Volatility Index Products	VOLA	100%	VSX1																	