clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 043/11

Datum: 10. Mai 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: 105/10

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

Zielgruppe:

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

Anhänge:

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

Zum **13. Mai 2011** nach der Tagesendverarbeitung erfolgt eine Anpassung der sektorenbasierten Margin-Gruppen.

Die Anlage enthält eine Übersicht über die mit Wirkung zum 13. Mai 2011 nach der Tagesendverarbeitung 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

Sector	Margin Group	Offset Factor	Margin Class Codes															
Fixed Income Products	BUBO	0%	FGBL	FGBM	FGBS	FGBX												
Automobiles & Parts	STXA	0%	BMW	CON	ESA	PEU	RNL	STA	VSA									
Banks	STXB	0%	BAKN	BDS	BDV	BNP	BSD2	CRI5	ESB	IES5	KDB	ME9	MPI	POP	SGE	STB	UBSN	XCA
Chemicals	STXC	0%	AIR	BAS	BAY	ESC	LIN	STC										
Oil & Gas	STXE	0%	ENT	ESE	F3D	REP	ROSB	ROY	SBMO	SPE	STE	THP	TOT					
Financial Services	STXF	0%	EAI	ESF	EUQ	MFX	STF											
Industrial Goods & Services	STXG	0%	ABBN	ESG	FRA	G1A	IMI	LRC	MAN	SIE	SND	STG	TKA	VLM				
Health Care	STXH	0%	ESH	NOVN	SNW	STH												
Insurance	STXI	0%	AEN	ALV	ASG	AV	AXA	BALN	ESI	INN	PRU	SLF	STI	ZURN				
Travel & Leisure	STXL	0%	AFR	BAI	ESV	LHA	STV	WTB										
Media	STXM	0%	DMG	ESM	INF	PSO	PU4	STM	SWS	UBM	VVU	WPP						
Construction & Materials	STXN	0%	BYG	CIL	ESN	GBF	GOB	HEI	HOLN	SQU	STN							
Food & Beverage	STXO	0%	ESO	HNK	ITK	STO	ULV	UNI										
Basic Resources	STXS	0%	AAL	ATO	BLT	ERA	ERS	ESS	KAZ	LMI	NKF	RIO	RKK	STS	SZG	VAS	XTA	
Telecommunications	STXT	0%	DTE	EST	FTE	STT	TNE5											
Utilities	STXU	0%	ENL5	EOA	ESU	GZF	IBE	STU										
Non-Sector Index Products	DMIX	43%	2MI	600	DAX	EUN2	EUSX	EXS1	FOX	GTD	MDAX	SMI	SMIM	STXX				
Real Estate	STXV	43%	BLN	HMS	LAN													
Personal & Household Goods	STXP	50%	CFR	DIO	ESZ	LUX	MOH	STZ	UHR	UHRN								
Technology	STXY	50%	ESY	IFX	SGM	STY												
Money Market Products	LIBO	100%	FEO1	FEU3														
Retail	STXR	100%	CAR	ESR	STR													
Fixed Income Products - CONF	SWIS	100%	CONF															
Volatility Index Products	VOLA	100%	VSX1															