clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 128/16

Datum: 20. Oktober 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

Eurex Bonds- und Eurex Repo-Instrumente: Anpassung der Input-Parameter für die Aktualisierung der Risikoparameter am 26. Oktober 2016

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 112/16

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

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- IT/System Administration

Anhänge:

Keine

Zusammenfassung:

Im Zuge der regelmäßigen Aktualisierung der Input-Parameter für die Bestimmung der Margin-Parameter für Eurex Bonds- und Eurex Repo-Instrumente wurden die Input-Parameter wie folgt neu bestimmt und werden mit der ersten untertägigen Verarbeitung am **26. Oktober 2016** 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. Hugo Bänziger

Vorstand:
Eric Tim Müller
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Manfred Matusza,

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main

Eurex Bonds- und Eurex Repo-Instrumente: Anpassung der Input-Parameter für die Aktualisierung der Risikoparameter am 26. Oktober 2016

Die folgende Tabelle zeigt (in englischer Sprache) die derzeitige Zuordnung von Kreditrisiko- und Liquiditäts-faktoren mit der ersten untertägigen Verarbeitung am 26. Oktober 2016:

Bond type	Credit risk factor (update 26. Oktober 2016)		Liquidity factor
Italian government bonds or Jumbo	Credit Spread ^{Italy}	0.6154	1.14
Spanish government bonds or Jumbo	Credit Spread ^{Spain}	0.2436	1.17
Irish government bonds or Jumbo	Credit Spread ^{Ireland}	0.1853	1.08
Other government bonds or Jumbo	0	0,0000	1.00
Italian corporate bonds	Max(Credit Spread ^{Italy} , risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds)	1.5472	1.2
Spanish corporate bonds	Max(Credit Spread ^{Spain} , risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds)	1.5472	1.17
Irish corporate bonds	Max(Credit Spread ^{Ireland} , risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds)	1.5472	1.08
Other corporate bonds	risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds	1.5472	1.25

Die Veröffentlichung der aktuellen Risikoparameter für Eurex Bonds- und Eurex Repo-Instrumente bleibt unverändert und wird auf der Website der Eurex Clearing www.eurexclearing.com unter folgendem Link zur Verfügung gestellt:

Risikomanagement > Risikoparameter > Margin-Parameter für Anleihen und Repos

Bei Fragen wenden Sie sich bitte an Risk Control unter Tel. +49-69-211-1 24 52 oder E-Mail: risk@eurexclearing.com.

20. Oktober 2016