clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 009/10

Datum: Frankfurt, 5. Februar 2010
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 15. Februar 2010

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 044/09, 063/09

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Middle + Backoffice ➲ Revision/Security Coordination	Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen zum 15. Februar 2010

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **15. Februar 2010** gültigen Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

Die Anlage umfasst die Sicherheitsabschläge der von Eurex anerkannten internationalen Währungen.

Eurex Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
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, Thomas Lenz, Michael Peters, Peter Reitz

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

Eurex Cross Currency Haircuts as of February 15, 2010

Eurex Currency	Cross Currency	Cross Currency Name	Current Cross Currency Haircut	New Cross Currency Haircut
CHF	AUD	AUSTRAL DOLLAR	7.80%	**6.80%**
CHF	CAD	CANADA DOLLAR	4.40%	**3.80%**
CHF	DKK	DANISH KRONE	2.90%	**2.10%**
CHF	GBP	GB POUND	5.30%	**4.00%**
CHF	JPY	JAPANESE YEN	5.30%	**4.50%**
CHF	NOK	NORWEGIAN KRON	6.40%	**4.60%**
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	7.00%	**5.30%**
CHF	USD	US DOLLAR	3.80%	**3.10%**
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	5.90%	**5.00%**
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	3.40%	**3.10%**
EUR	CHF	SWISS FRANCS	2.90%	**2.10%**
EUR	DKK	DANISH KRONE	1.00%	**1.00%**
EUR	GBP	GB POUND	4.40%	**3.40%**
EUR	JPY	JAPANESE YEN	6.30%	**5.40%**
EUR	NOK	NORWEGIAN KRON	4.50%	**3.50%**
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	5.30%	**4.30%**
EUR	USD	US DOLLAR	3.80%	**3.00%**