Eurex Clearing-Rundschreiben 016/18

EurexOTC IRS: Aktualisierung der Liquidity-Faktoren und des Decay-Faktors mit Wirkung zum 19. Februar 2018

Die Liquidity-Faktoren und der Decay-Faktor für die EWMA-Volatilität für EurexOTC IRS werden regelmäßig überprüft und am **19. Februar 2018** vor der ersten Berechnung des Tages aktualisiert.

Die veränderten Werte werden im Report „CC220 Liquidity Table“ für die Liquidity-Faktoren und im Report „CC221 Parameter File“, jeweils im csv-Format, auf der Common Report Engine zur Verfügung gestellt.

Anhänge:

- keine

Datum: 9. Februar 2018

Empfänger:
Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren

Autorisiert von:
Thomas Laux

Zielgruppe:
Front Office/Handel
Middle + Backoffice
IT/System Administration

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