clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 105/11

Datum: 23. Dezember 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 2. Januar 2012

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 075/11

Kontakt: 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 ab dem Batch-Lauf vom 2. Januar 2012

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **2. Januar 2012** gültigen Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

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

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

Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen ab dem Batch-Lauf vom 2. Januar 2012

Eurex Currency	Cross Currency	Cross Currency Name	Current Cross Currency Haircut	New Cross Currency Haircut
CHF	AUD	AUSTRAL DOLLAR	9.70%	**6.80%**
CHF	CAD	CANADA DOLLAR	6.60%	**4.80%**
CHF	DKK	DANISH KRONE	8.90%	**6.60%**
CHF	GBP	GB POUND	7.00%	**5.10%**
CHF	JPY	JAPANESE YEN	7.70%	**4.80%**
CHF	NOK	NORWEGIAN KRON	9.90%	**6.60%**
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	9.90%	**7.30%**
CHF	USD	US DOLLAR	7.00%	**4.70%**
CHF	KRW	KOREAN WON	9.90%	**7.50%**
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	5.20%	**5.00%**
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	3.10%	**3.10%**
EUR	CHF	SWISS FRANCS	9.10%	**6.70%**
EUR	DKK	DANISH KRONE	1.00%	**1.00%**
EUR	GBP	GB POUND	2.90%	**2.80%**
EUR	JPY	JAPANESE YEN	5.10%	**5.10%**
EUR	NOK	NORWEGIAN KRON	4.40%	**2.80%**
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	4.40%	**3.00%**
EUR	USD	US DOLLAR	3.40%	**3.00%**
EUR	KRW	KOREAN WON	5.50%	**5.50%**