clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 045/12

Datum: 11. Juni 2012
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung ab der Tagesendverarbeitung vom 14. Juni 2012

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 026/12

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Middle + Backoffice ➲ Revision/Security Coordination	Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen ab der Tagesendverarbeitung vom 14. Juni 2012

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab der Tagesendverarbeitung vom **14. Juni 2012** gültigen Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

Die Anlage umfasst die Sicherheitsabschläge der von der 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:
Dr. Reto Francioni

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 der Tagesendverarbeitung vom 14. Juni 2012:

Eurex Currency	Cross Currency	Cross Currency Name	Current Cross Currency Haircut	New Cross Currency Haircut
CHF	AUD	AUSTRALIAN DOLLAR	6.80%	6.80%
CHF	CAD	CANADIAN DOLLAR	4.50%	4.10%
CHF	DKK	DANISH KRONE	5.40%	4.40%
CHF	GBP	GB POUND	4.70%	4.70%
CHF	JPY	JAPANESE YEN	4.80%	4.80%
CHF	NOK	NORWEGIAN KRONE	6.10%	5.50%
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	6.30%	5.60%
CHF	USD	US DOLLAR	4.70%	4.70%
CHF	KRW	KOREAN WON	7.50%	7.50%
EUR	AUD	AUSTRALIAN DOLLAR	5.00%	5.00%
EUR	CAD	CANADIAN DOLLAR	3.10%	3.10%
EUR	CHF	SWISS FRANCS	5.50%	4.50%
EUR	DKK	DANISH KRONE	1.00%	1.00%
EUR	GBP	GB POUND	2.80%	2.80%
EUR	JPY	JAPANESE YEN	5.10%	5.10%
EUR	NOK	NORWEGIAN KRONE	3.00%	2.80%
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	2.70%	2.60%
EUR	USD	US DOLLAR	3.00%	2.70%
EUR	KRW	KOREAN WON	5.50%	5.50%

USD	AUD	AUSTRALIAN DOLLAR	-	6.50%
USD	CAD	CANADIAN DOLLAR	-	3.10%
USD	CHF	SWISS FRANCS	-	4.70%
USD	DKK	DANISH KRONE	-	2.70%
USD	GBP	GB POUND	-	3.00%
USD	JPY	JAPANESE YEN	-	3.30%
USD	NOK	NORWEGIAN KRONE	-	4.50%
USD	SEK	SWEDISH KRONA	-	4.30%
USD	EUR	EURO	-	2.70%
USD	KRW	KOREAN WON	-	5.40%

11. Juni 2012