clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 024/11

Datum: 21. März 2011
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 24. März 2011

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 009/10, 022/10, 053/10, 077/10

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 zum 24. März 2011

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **24. März 2011** 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 24. März 2011

Eurex Currency	Cross Currency	Cross Currency Name	Current Cross Currency Haircut	New Cross Currency Haircut
CHF	AUD	AUSTRAL DOLLAR	6.80%	**7.30%**
CHF	CAD	CANADA DOLLAR	3.90%	**3.90%**
CHF	DKK	DANISH KRONE	4.20%	**4.20%**
CHF	GBP	GB POUND	3.60%	**3.90%**
CHF	JPY	JAPANESE YEN	3.90%	**5.20%**
CHF	NOK	NORWEGIAN KRON	4.00%	**4.70%**
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	4.00%	**5.60%**
CHF	USD	US DOLLAR	3.20%	**3.60%**
CHF	KRW	KOREAN WON	7.50%	**8.80%**
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	5.60%	**6.60%**
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	3.80%	**3.30%**
EUR	CHF	SWISS FRANCS	4.20%	**4.30%**
EUR	DKK	DANISH KRONE	1.00%	**1.00%**
EUR	GBP	GB POUND	3.00%	**3.20%**
EUR	JPY	JAPANESE YEN	5.40%	**5.70%**
EUR	NOK	NORWEGIAN KRON	3.60%	**3.60%**
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	2.90%	**3.10%**
EUR	USD	US DOLLAR	3.00%	**3.10%**
EUR	KRW	KOREAN WON	8.80%	**9.90%**

21. März 2011