clear to trade

# eurex clearing
## *rundschreiben 077/10*

**Datum:** Frankfurt, 1. November 2010
**Empfänger:** Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
**Autorisiert von:** Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

## Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 10. November 2010

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

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

| **Zielgruppe:** | **Anhang:** |
|---|---|
| ➲ Middle + Backoffice<br>➲ Revision/Security Coordination | Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen zum 10. November 2010 |

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **10. November 2010** 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 10. November 2010**

| Eurex Currency | Cross Currency | Cross Currency Name | Current Cross Currency Haircut | New Cross Currency Haircut |
|---|---|---|---|---|
| CHF | AUD | AUSTRAL DOLLAR | 6.80% | **6.80%** |
| CHF | CAD | CANADA DOLLAR | 3.90% | **3.80%** |
| CHF | DKK | DANISH KRONE | 4.20% | **3.90%** |
| CHF | GBP | GB POUND | 3.60% | **3.60%** |
| CHF | JPY | JAPANESE YEN | 3.90% | **3.90%** |
| CHF | NOK | NORWEGIAN KRON | 4.00% | **3.90%** |
| CHF | SEK | SWEDISH KRONA | 4.00% | **5.30%** |
| CHF | USD | US DOLLAR | 3.20% | **3.30%** |
| CHF | KRW | KOREAN WON | 7.50% | **7.50%** |
| EUR | AUD | AUSTRAL DOLLAR | 5.60% | **5.00%** |
| EUR | CAD | CANADA DOLLAR | 3.80% | **3.10%** |
| EUR | CHF | SWISS FRANCS | 4.20% | **4.00%** |
| EUR | DKK | DANISH KRONE | 1.00% | **1.00%** |
| EUR | GBP | GB POUND | 3.00% | **3.40%** |
| EUR | JPY | JAPANESE YEN | 5.40% | **5.40%** |
| EUR | NOK | NORWEGIAN KRON | 3.60% | **3.20%** |
| EUR | SEK | SWEDISH KRONA | 2.90% | **2.70%** |
| EUR | USD | US DOLLAR | 3.00% | **3.40%** |
| EUR | KRW | KOREAN WON | 8.80% | **7.00%** |

Frankfurt, 1. November 2010