clear to trade

# e u r e x  c l e a r i n g
# *rundschreiben 022/10*

**Datum:** Frankfurt, 27. April 2010
**Empfänger:** Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
**Autorisiert von:** Thomas Book

⚠ **Hohe Priorität**

## Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 3. Mai 2010

**Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben:** 063/09, 009/10

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

| **Zielgruppe:** | **Anhang:** |
|---|---|
| Ü Middle + Backoffice<br>Ü Revision/Security Coordination | Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen zum 3. Mai 2010 |

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **3. Mai 2010** gültigen Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

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

Eurex Clearing AG
Neue Börsenstraße 1
60487 Frankfurt/Main
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 Cross Currency Haircuts ab dem 3. Mai 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 | 3,80% | **3,80%** |
| CHF | DKK | DANISH KRONE | 2,10% | **2,10%** |
| CHF | GBP | GB POUND | 4,00% | **3,60%** |
| CHF | JPY | JAPANESE YEN | 4,50% | **3,90%** |
| CHF | NOK | NORWEGIAN KRON | 4,60% | **3,70%** |
| CHF | SEK | SWEDISH KRONA | 5,30% | **4,00%** |
| CHF | USD | US DOLLAR | 3,10% | **3,10%** |
| CHF | KRW | KOREAN WON | 7,50% | **7,50%** |
| EUR | AUD | AUSTRAL DOLLAR | 5,00% | **5,00%** |
| EUR | CAD | CANADA DOLLAR | 3,10% | **3,10%** |
| EUR | CHF | SWISS FRANCS | 2,10% | **2,10%** |
| EUR | DKK | DANISH KRONE | 1,00% | **1,00%** |
| EUR | GBP | GB POUND | 3,40% | **3,00%** |
| EUR | JPY | JAPANESE YEN | 5,40% | **5,40%** |
| EUR | NOK | NORWEGIAN KRON | 3,50% | **3,20%** |
| EUR | SEK | SWEDISH KRONA | 4,30% | **3,40%** |
| EUR | USD | US DOLLAR | 3,00% | **2,90%** |
| EUR | KRW | KOREAN WON | 7,00% | **7,00%** |