clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 100/16

Datum: 27. Juli 2016
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

⚠ **Hohe Priorität**

Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung ab der Tagesendverarbeitung vom 1. August 2016

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 090/16

Kontakt: Risk Control, T +49-69-211-1 24 52, F +49-69-211-1 84 40, risk@eurexclearing.com

Zielgruppe:	**Anhang:**
➲ Middle + Back Office ➲ Revision/Security Coordination	Sicherheitsabschläge der Eurex Clearing auf Währungen ab der Tagesendverarbeitung vom 1. August 2016

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab der Tagesendverarbeitung vom **1. August 2016** gültigen Sicherheitsabschläge der Eurex Clearing auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

Bitte beachten Sie die neu eingeführten Sicherheitsabschläge mit der Einführung von britischem Pfund (GBP) als Clearing-Währung.

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

Eurex Clearing AG
Mergenthalerallee 61
65760 Eschborn
Postanschrift:
60485 Frankfurt/Main
Deutschland

T +49-69-211-1 17 00
F +49-69-211-1 17 01
memberservices@
eurexclearing.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Hugo Bänziger

Vorstand:
Erik Tim Müller (Vorsitzender),
Heike Eckert (stv. Vorsitzende),
Matthias Graulich,
Thomas Laux,
Manfred Matusza

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
USt-IdNr. DE194821553
Amtsgericht Frankfurt/Main

Sicherheitsabschläge der Eurex Clearing auf Währungen ab der Tagesendverarbeitung vom 1. August 2016:

BASE CURRENCY	CROSS CURRENCY	CROSS CURRENCY NAME	CURRENT CROSS CURRENCY HAIRCUT	NEW CROSS CURRENCY HAIRCUT
CHF	AUD	AUSTRAL DOLLAR	8.12%	8.12%
CHF	CAD	CANADA DOLLAR	6.94%	6.94%
CHF	CNY	CHINESE RENMINBI	6.97%	6.97%
CHF	DKK	DANISH KRONE	5.62%	5.62%
CHF	EUR	EURO	6.00%	6.00%
CHF	GBP	GB POUND	9.99%	7.85%
CHF	JPY	JAPANESE YEN	8.88%	7.16%
CHF	KRW	KOREAN WON	7.74%	7.74%
CHF	NOK	NORWEGIAN KRONE	6.23%	6.23%
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	6.16%	6.16%
CHF	TWD	TAIWANESE DOLLAR	6.01%	6.01%
CHF	USD	US DOLLAR	6.28%	6.28%
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	7.86%	7.86%
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	3.97%	3.97%
EUR	CHF	SWISS FRANCS	6.00%	6.00%
EUR	CNY	CHINESE RENMINBI	4.99%	3.85%
EUR	DKK	DANISH KRONE	3.76%	3.76%
EUR	GBP	GB POUND	9.86%	7.09%
EUR	JPY	JAPANESE YEN	9.99%	8.10%
EUR	KRW	KOREAN WON	9.07%	9.07%
EUR	NOK	NORWEGIAN KRONE	4.07%	4.07%
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	3.76%	3.76%
EUR	TWD	TAIWANESE DOLLAR	3.61%	3.61%
EUR	USD	US DOLLAR	4.99%	4.34%

USD	AUD	AUSTRAL DOLLAR	8.40%	8.40%
USD	CAD	CANADA DOLLAR	5.04%	5.04%
USD	CHF	SWISS FRANCS	6.28%	6.28%
USD	CNY	CHINESE RENMINBI	1.70%	1.30%
USD	DKK	DANISH KRONE	4.94%	4.17%
USD	EUR	EURO	4.99%	4.34%
USD	GBP	GB POUND	9.99%	9.38%
USD	JPY	JAPANESE YEN	6.17%	5.34%
USD	KRW	KOREAN WON	8.53%	8.53%
USD	NOK	NORWEGIAN KRONE	7.85%	5.67%
USD	SEK	SWEDISH KRONA	7.86%	5.47%
USD	TWD	TAIWANESE DOLLAR	3.58%	3.58%
GBP	AUD	AUSTRAL DOLLAR	N/A	7.44%
GBP	CAD	CANADA DOLLAR	N/A	7.47%
GBP	CHF	SWISS FRANCS	N/A	7.85%
GBP	CNY	CHINESE RENMINBI	N/A	8.96%
GBP	DKK	DANISH KRONE	N/A	6.72%
GBP	EUR	EURO	N/A	7.09%
GBP	JPY	JAPANESE YEN	N/A	9.99%
GBP	KRW	KOREAN WON	N/A	7.66%
GBP	NOK	NORWEGIAN KRONE	N/A	5.81%
GBP	SEK	SWEDISH KRONA	N/A	5.95%
GBP	TWD	TAIWANESE DOLLAR	N/A	7.86%
GBP	USD	US DOLLAR	N/A	9.38%