clear to trade

e u r e x c l e a r i n g
rundschreiben 053/10

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

⚠ **Hohe Priorität**

Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 2. August 2010

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

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

Zielgruppe:	**Anhang:**
Ü Middle + Backoffice Ü Revision/Security Coordination	Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen zum 2. August 2010

Zusammenfassung:

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **2. August** 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 2. August 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%	**3.90%**
CHF	DKK	DANISH KRONE	2.10%	**4.20%**
CHF	GBP	GB POUND	3.60%	**3.60%**
CHF	JPY	JAPANESE YEN	3.90%	**3.90%**
CHF	NOK	NORWEGIAN KRON	3.70%	**4.00%**
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	4.00%	**4.00%**
CHF	USD	US DOLLAR	3.10%	**3.20%**
CHF	KRW	KOREAN WON	7.50%	**7.50%**
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	5.00%	**5.60%**
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	3.10%	**3.80%**
EUR	CHF	SWISS FRANCS	2.10%	**4.20%**
EUR	DKK	DANISH KRONE	1.00%	**1.00%**
EUR	GBP	GB POUND	3.00%	**3.00%**
EUR	JPY	JAPANESE YEN	5.40%	**5.40%**
EUR	NOK	NORWEGIAN KRON	3.20%	**3.60%**
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	3.40%	**2.90%**
EUR	USD	US DOLLAR	2.90%	**3.00%**
EUR	KRW	KOREAN WON	7.00%	**8.80%**