# Eurex Clearing-Rundschreiben 014/18

## Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung ab der Tagesendverarbeitung vom 12. Februar 2018

### Zusammenfassung

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab der Tagesendverarbeitung vom 12. Februar 2018 gültigen Sicherheitsabschläge der Eurex Clearing AG auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

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

**Anhang:**

Sicherheitsabschläge der Eurex Clearing auf Währungen ab der Tagesendverarbeitung vom 12. Februar 2018

**Datum:** 7. Februar 2018

**Empfänger:**
Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren

**Autorisiert von:**
Thomas Laux

**Zielgruppe:**
Middle + Back Office
Revision/Security Coordination

**Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben:**
001/18

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

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

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 12. Februar 2018

| BASE CURRENCY | CROSS CURRENCY | CROSS CURRENCY NAME | CURRENT CROSS CURRENCY HAIRCUT | NEW CROSS CURRENCY HAIRCUT |
|---|---|---|---|---|
| CHF | AUD | AUSTRAL DOLLAR | 8.1% | 8.1% |
| CHF | CAD | CANADA DOLLAR | 6.9% | 6.9% |
| CHF | CNY | CHINESE RENMINBI | 6.1% | 6.1% |
| CHF | DKK | DANISH KRONE | 5.6% | 5.6% |
| CHF | EUR | EURO | 6.0% | 6.0% |
| CHF | GBP | GB POUND | 7.1% | 7.1% |
| CHF | JPY | JAPANESE YEN | 6.3% | 6.3% |
| CHF | KRW | KOREAN WON | 7.7% | 7.7% |
| CHF | NOK | NORWEGIAN KRONE | 6.2% | 6.2% |
| CHF | NZD | NEW ZEALAND DOLLAR | 6.8% | 6.8% |
| CHF | PLN | POLISH ZLOTY | 7.6% | 7.6% |
| CHF | SEK | SWEDISH KRONA | 6.2% | 6.2% |
| CHF | TWD | TAIWANESE DOLLAR | 6.0% | 6.0% |
| CHF | USD | US DOLLAR | 6.3% | 6.3% |
| EUR | AUD | AUSTRAL DOLLAR | 7.9% | 7.9% |
| EUR | CAD | CANADA DOLLAR | 4.0% | 4.0% |
| EUR | CHF | SWISS FRANCS | 6.0% | 6.0% |
| EUR | CNY | CHINESE RENMINBI | 4.3% | 4.3% |
| EUR | DKK | DANISH KRONE | 3.8% | 3.8% |
| EUR | GBP | GB POUND | 5.3% | 5.3% |
| EUR | JPY | JAPANESE YEN | 7.0% | 7.0% |
| EUR | KRW | KOREAN WON | 9.1% | 9.1% |
| EUR | NOK | NORWEGIAN KRONE | 4.1% | 4.1% |
| EUR | NZD | NEW ZEALAND DOLLAR | 5.2% | 5.2% |
| EUR | PLN | POLISH ZLOTY | 5.1% | 5.1% |
| EUR | SEK | SWEDISH KRONA | 3.8% | 3.8% |
| EUR | TWD | TAIWANESE DOLLAR | 3.5% | 3.5% |
| EUR | USD | US DOLLAR | 4.3% | 4.3% |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | AUD | AUSTRAL DOLLAR | 8.4% | 8.4% |
| USD | CAD | CANADA DOLLAR | 5.0% | 5.0% |
| USD | CHF | SWISS FRANCS | 6.3% | 6.3% |
| USD | CNY | CHINESE RENMINBI | 1.5% | 2.0% |
| USD | DKK | DANISH KRONE | 4.2% | 4.2% |
| USD | EUR | EURO | 4.3% | 4.3% |
| USD | GBP | GB POUND | 5.6% | 5.6% |
| USD | JPY | JAPANESE YEN | 4.2% | 4.2% |
| USD | KRW | KOREAN WON | 8.5% | 8.5% |
| USD | NOK | NORWEGIAN KRONE | 5.0% | 5.0% |
| USD | NZD | NEW ZEALAND DOLLAR | 6.8% | 6.8% |
| USD | PLN | POLISH ZLOTY | 7.3% | 7.3% |
| USD | SEK | SWEDISH KRONA | 5.3% | 5.3% |
| USD | TWD | TAIWANESE DOLLAR | 3.6% | 3.6% |
| GBP | AUD | AUSTRAL DOLLAR | 6.8% | 6.8% |
| GBP | CAD | CANADA DOLLAR | 5.1% | 5.1% |
| GBP | CHF | SWISS FRANCS | 7.1% | 7.1% |
| GBP | CNY | CHINESE RENMINBI | 5.3% | 5.3% |
| GBP | DKK | DANISH KRONE | 5.1% | 5.1% |
| GBP | EUR | EURO | 5.3% | 5.3% |
| GBP | JPY | JAPANESE YEN | 8.8% | 8.8% |
| GBP | KRW | KOREAN WON | 7.7% | 7.7% |
| GBP | NOK | NORWEGIAN KRONE | 4.8% | 4.8% |
| GBP | NZD | NEW ZEALAND DOLLAR | 4.9% | 4.9% |
| GBP | PLN | POLISH ZLOTY | 5.9% | 5.9% |
| GBP | SEK | SWEDISH KRONA | 6.0% | 6.0% |
| GBP | TWD | TAIWANESE DOLLAR | 4.5% | 4.5% |
| GBP | USD | US DOLLAR | 5.6% | 5.6% |