Eurex Clearing-Rundschreiben 019/18

Eurex Repo-Instrumente: Anpassung der Input-Parameter für die Aktualisierung der Risikoparameter am 16. Februar 2018

Zusammenfassung

Im Zuge der regelmäßigen Aktualisierung der Input-Parameter für die Bestimmung der Margin-Parameter für Eurex Repo-Instrumente wurden die Input-Parameter wie folgt neu bestimmt und werden mit der ersten untertägigen Verarbeitung am **16. Februar 2018** gültig.

Anhänge:

keine

Datum: 14. Februar 2018

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

Autorisiert von: Thomas Laux

Zielgruppe:
Front Office/Handel
Middle + Backoffice
IT/System Administration

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben:
125/17

Kontakt:
Risk Control, T +49-69-211-1 28 28,
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

Eurex Repo-Instrumente: Anpassung der Input-Parameter für die Aktualisierung der Risikoparameter am 16. Februar 2018

Die folgende Tabelle zeigt (in englischer Sprache) die derzeitige Zuordnung von Kreditrisiko- und Liquiditäts-faktoren mit der ersten untertägigen Verarbeitung am 16. Februar 2018:

Bond type	Credit Risk Factor (update 09.02.2018)		Liquidity Factor
Italian government bonds or Jumbo	Credit Spread ^{Italy}	0.7553	1.14
Spanish government bonds or Jumbo	Credit Spread ^{Spain}	0.3565	1.11
Irish government bonds or Jumbo	Credit Spread ^{Ireland}	0.1898	1.13
Other government bonds or Jumbo		0.0821	1.033
Italian corporate bonds	Max(Credit Spread ^{Italy} , risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds)	1.1497	1.15
Spanish corporate bonds	Max(Credit Spread ^{Spain} , risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds)	1.1497	1.11
Irish corporate bonds	Max(Credit Spread ^{Ireland} , risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds)	1. 1497	1.13
Other corporate bonds	risk-free yield curve vs. EUR corporate bonds	1. 1497	1.23

Die Veröffentlichung der aktuellen Risikoparameter für Eurex Repo-Instrumente bleibt unverändert und wird auf der Website der Eurex Clearing www.eurexclearing.com unter folgendem Link zur Verfügung gestellt:

Risikomanagement > Risikoparameter > Margin-Parameter für Anleihen und Repos

Bei Fragen wenden Sie sich bitte an Risk Control unter Tel. +49-69-211-1 28 28 oder E-Mail: risk@eurexclearing.com.

13. Februar 2018