clear to trade

eurex clearing
rundschreiben 079/17

Datum: 25. August 2017
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Laux

Aktualisierung der Liquidity-Faktoren und des Decay-Faktors für OTC IRS mit Wirkung zum 31. August 2017

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

Zielgruppe:

- Front Office/Handel
- Middle + Backoffice
- IT/System Administration

Anhänge:
keine

Die Liquidity-Faktoren und der Decay-Faktor für die EWMA-Volatilität werden regelmäßig überprüft und am **31. August 2017** vor der ersten Berechnung des Tages aktualisiert.

Die veränderten Werte werden im Report CC220 Liquidity Table für die Liquidity-Faktoren und im Report CC221 Parameter File, jeweils im csv-Format, auf der Common Report Engine zur Verfügung gestellt.

eurex clearing

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

Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des Aufsichtsrats:
Dr. Hugo Bänziger

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

Aktiengesellschaft mit Sitz in Frankfurt/Main
HRB Nr. 44828
Amtsgericht Frankfurt/Main