

clear to trade



eurex clearing

rundschreiben 009/10

Datum: Frankfurt, 5. Februar 2010
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Book

 Hohe Priorität

Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 15. Februar 2010

Verweis auf Eurex Clearing-Rundschreiben: 044/09, 063/09

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

Zielgruppe:

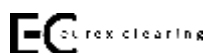
- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhang:

Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen
zum 15. Februar 2010

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **15. Februar 2010** 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
eurexexchange.com
Internet:
www.eurexclearing.com

Vorsitzender des
Aufsichtsrats:
Prof. Dr. Peter Gomez

Vorstand:
Andreas Preuß (Vorsitzender),
Jürg Spillmann, Thomas Book,
Gary Katz, Thomas Lenz,
Michael Peters, Peter Reitz

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


Eurex Cross Currency Haircuts as of February 15, 2010

Eurex Currency	Cross Currency	Cross Currency Name	Current Cross Currency Haircut	New Cross Currency Haircut
CHF	AUD	AUSTRAL DOLLAR	7.80%	6.80%
CHF	CAD	CANADA DOLLAR	4.40%	3.80%
CHF	DKK	DANISH KRONE	2.90%	2.10%
CHF	GBP	GB POUND	5.30%	4.00%
CHF	JPY	JAPANESE YEN	5.30%	4.50%
CHF	NOK	NORWEGIAN KRON	6.40%	4.60%
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	7.00%	5.30%
CHF	USD	US DOLLAR	3.80%	3.10%
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	5.90%	5.00%
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	3.40%	3.10%
EUR	CHF	SWISS FRANCS	2.90%	2.10%
EUR	DKK	DANISH KRONE	1.00%	1.00%
EUR	GBP	GB POUND	4.40%	3.40%
EUR	JPY	JAPANESE YEN	6.30%	5.40%
EUR	NOK	NORWEGIAN KRON	4.50%	3.50%
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	5.30%	4.30%
EUR	USD	US DOLLAR	3.80%	3.00%