

clear to trade



## eurex clearing rundschriften 077/10

**Datum:** Frankfurt, 1. November 2010  
**Empfänger:** Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren  
**Autorisiert von:** Thomas Book

 Hohe Priorität

### Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 10. November 2010

**Verweis auf Eurex Clearing-Rundschriften:** 009/10, 022/10, 053/10

**Kontakt:** Risk Operations, Tel. +49-69-211-1 24 52, E-Mail: [risk@eurexchange.com](mailto:risk@eurexchange.com)

**Zielgruppe:**

- ➔ Middle + Backoffice
- ➔ Revision/Security Coordination

**Anhang:**

Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen  
zum 10. November 2010

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **10. November 2010** gültigen Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

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



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

T +49-69-211-1 24 52  
F +49-69-211-1 84 40  
[risk@eurexexchange.com](mailto:risk@eurexexchange.com)  
[eurexexchange.com](http://eurexexchange.com)  
Internet:  
[www.eurexclearing.com](http://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-Sicherheitsabschläge auf Währungen ab dem 10. November 2010

Eurex Currency	Cross Currency	Cross Currency Name	Current Cross Currency Haircut	New Cross Currency Haircut
CHF	AUD	AUSTRAL DOLLAR	6.80%	<b>6.80%</b>
CHF	CAD	CANADA DOLLAR	3.90%	<b>3.80%</b>
CHF	DKK	DANISH KRONE	4.20%	<b>3.90%</b>
CHF	GBP	GB POUND	3.60%	<b>3.60%</b>
CHF	JPY	JAPANESE YEN	3.90%	<b>3.90%</b>
CHF	NOK	NORWEGIAN KRON	4.00%	<b>3.90%</b>
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	4.00%	<b>5.30%</b>
CHF	USD	US DOLLAR	3.20%	<b>3.30%</b>
CHF	KRW	KOREAN WON	7.50%	<b>7.50%</b>
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	5.60%	<b>5.00%</b>
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	3.80%	<b>3.10%</b>
EUR	CHF	SWISS FRANCS	4.20%	<b>4.00%</b>
EUR	DKK	DANISH KRONE	1.00%	<b>1.00%</b>
EUR	GBP	GB POUND	3.00%	<b>3.40%</b>
EUR	JPY	JAPANESE YEN	5.40%	<b>5.40%</b>
EUR	NOK	NORWEGIAN KRON	3.60%	<b>3.20%</b>
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	2.90%	<b>2.70%</b>
EUR	USD	US DOLLAR	3.00%	<b>3.40%</b>
EUR	KRW	KOREAN WON	8.80%	<b>7.00%</b>