



eurex rundschreiben 009/08

Datum: Frankfurt, 11. Januar 2008
Empfänger: Alle Clearing-Mitglieder der Eurex Clearing AG und Vendoren
Autorisiert von: Thomas Lenz



Sicherheitsabschläge für Währungen: Anpassung zum 18. Januar 2008

Verweis auf Eurex-Rundschreiben: 148/07

Kontakt: Funktionales Helpdesk Clearing, Tel. +49-69-211-1 12 50
E-Mail: risk@eurexchange.com

Zielgruppe:

- Middle + Backoffice
- Revision/Security Coordination

Anhänge:

Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen
(Cross Currency Haircuts) zum 18. Januar 2008

Im Anhang erhalten Sie die Aufstellung der ab dem Batch-Lauf vom **18. Januar 2008** gültigen Eurex-Sicherheitsabschläge auf Währungen (Cross Currency Haircuts).

Die Anlage umfasst die Sicherheitsabschläge der von Eurex anerkannten internationalen Währungen. Die geänderten Werte sind markiert.



Eurex cross currency haircuts effective batch run January 18, 2008

Eurex Currency	Cross Currency	Cross Currency Name	Current Cross Currency Haircut	New Cross Currency Haircut
CHF	AUD	AUSTRAL DOLLAR	3,50%	4,00%
CHF	CAD	CANADA DOLLAR	2,60%	3,50%
CHF	DKK	DANISH KRONA	1,70%	1,50%
CHF	GBP	GB POUND	2,40%	2,80%
CHF	JPY	JAPANESE YEN	3,10%	2,90%
CHF	NOK	NORWEGIAN KRONA	1,80%	2,00%
CHF	RUB	RUSSIAN RUBLE	2,80%	2,60%
CHF	SEK	SWEDISH KRONA	2,20%	1,90%
CHF	USD	US DOLLAR	2,60%	2,50%
EUR	AUD	AUSTRAL DOLLAR	3,00%	3,20%
EUR	CAD	CANADA DOLLAR	2,50%	3,20%
EUR	CHF	SWISS FRANCS	1,70%	1,50%
EUR	DKK	DANISH KRONA	1,00%	1,00%
EUR	GBP	GB POUND	2,00%	2,50%
EUR	JPY	JAPANESE YEN	3,30%	3,00%
EUR	NOK	NORWEGIAN KRONA	1,70%	1,70%
EUR	RUB	RUSSIAN RUBLE	2,50%	2,40%
EUR	SEK	SWEDISH KRONA	1,80%	1,70%
EUR	USD	US DOLLAR	2,40%	2,40%