

Egyedi (Deviza Spot) fedezeti limit besorolás (szabályzat)

A deviza spot kockázat csökkentésének érdekében 2015.12.18-tól az alábbi (veszteség jellegű) letétképzési szabályok (besorolások) lépnek életbe a **CODEX Tőzsdeügynökség Zrt-nél** (továbbiakban: *Társaság*). Az **FXCM** (továbbiakban : *Szolgáltató*) az egyedi devizák árfolyamváltozása alapján havi rendszerességgel – előre bejelentett időpontra- közli a letéti követelmények számításának alapjául szolgáló minimális letéti követelményeket. A szolgáltató nem zárja ki az extrém árfolyammozgások okozta letéti követelmény változtatás előzetes bejelentés nélküli, rendkívüli módosítását sem, ezért a Társaság is fenntartja a rendkívüli letéti követelmény módosítás lehetőségét.

A korábban alkalmazott fedezetképzési szabályok a hatályba lépést követően az alábbiak alapján változnak:

- A fedezetképzés alapjául szolgáló veszteség jellegű különbözet minimális mértékének meghatározása devizapáronként / termékenként a kockázati kategória besorolás alapján kerül meghatározásra
- A kategória besorolás alapjául a szolgáltató havi rendszerességgel frissített valamint a rendkívüli **FX Margin Update** táblázata szolgál, de a társaság vezetése egyedi szempontok alapján eltérhet a jelen szabályzatban foglaltaktól.
- A kategória besorolás EUR illetve USD devizanemenként kerül meghatározásra
- A devizapárokat az alábbi kategóriák alapján különböztetjük meg
 - **1. Kategória:** Azok a devizapárok és indexek valamint árupiaci termékek kerülnek az első kategóriába, amelyeknél az FXCM letéti feltétele a pozíció méretének legfeljebb 3,3 %. Az első kategóriában a minimális letéti követelmény a kötési ár és a stop megbízás aktiválási ára közötti veszteség jellegű különbözet **120%-a**.
 - **2. Kategória:** Azok a devizapárok és indexek valamint árupiaci termékek kerülnek a második kategóriába, amelyeknél az FXCM letéti feltétele a pozíció méretének legalább 3,4 % és legfeljebb 6,6 %-a. A második kategóriában a minimális letéti követelmény a kötési ár és a stop megbízás aktiválási ára közötti veszteség jellegű különbözet **140%-a**.
 - **3. Kategória:** Azok a devizapárok és indexek valamint árupiaci termékek kerülnek a harmadik kategóriába, amelyeknél az FXCM letéti feltétele a pozíció méretének legalább 6,7 % és legfeljebb 15 %-a. A harmadik kategóriában a minimális letéti követelmény a kötési ár és a stop megbízás aktiválási ára közötti veszteség jellegű különbözet **200 %-a**.

- **4. Kategória:** Azok a devizapárok és indexek valamint árupiaci termékek kerülnek a negyedik kategóriába, amelyeknél az FXCM letéti feltétele a pozíció méretének meghaladja a 15%-át. A negyedik kategóriába került deviza párok, indexek, árupiaci termékek esetén az üzletszabályzat vonatkozó rendelkezése alapján likvidálásra kerül az érintett pozíció.

EUR devizanemben nyitott deviza spot pozíciók esetében alkalmazott kategória besorolás

1 kategória	2 kategória	3 kategória	4 kategória
EUR/USD	USD/CHF	EUR/CHF	
USD/JPY	CHF/JPY	GBP/CHF	
GBP/USD	USD/MXN	USD/HKD	
AUD/USD	AUD/CHF	USD/ZAR	
USD/CAD	USD/TRY		
NZD/USD	EUR/TRY		
EUR/GBP	NZD/CHF		
EUR/JPY	CAD/CHF		
GBP/JPY	USD/CNH		
EUR/AUD	ITA 40		
EUR/CAD	HKG33		
AUD/CAD	YPN225		
AUD/JPY			
CAD/JPY			
NZD/JPY			
GBP/CAD			
GBP/NZD			
GBP/AUD			
AUD/NZD			
USD/SEK			
EUR/SEK			
EUR/NOK			
USD/NOK			
EUR/NZD			
ZAR/JPY			
NZD/CAD			
TRY/JPY			
EUR/HUF			
USD/HUF			
USDOLLAR			
SP35			
US30			
SPX500			
NAS100			

UK100 GER30 FRA40 SUI20 AUS200 EUSTX50 BUND USOIL UKOIL NGAS			
XAU/USD XAG/USD XPD/USD XPT/USD Copper			

USD devizanemben nyitott deviza spot pozíciók esetében alkalmazott kategória besorolás

1 kategória	2 kategória	3 kategória	4 kategória
EUR/USD USD/JPY GBP/USD AUD/USD USD/CAD NZD/USD EUR/GBP EUR/JPY GBP/JPY	USD/CHF CHF/JPY USD/MXN AUD/CHF USD/TRY EUR/TRY NZD/CHF CAD/CHF USD/CNH	EUR/CHF GBP/CHF USD/HKD USD/ZAR	
EUR/AUD EUR/CAD AUD/CAD AUD/JPY CAD/JPY NZD/JPY GBP/CAD AUD/NZD USD/SEK EUR/SEK	ITA 40 HKG33 YPN225 GBP/NZD GBP/AUD		
EUR/NOK USD/NOK EUR/NZD ZAR/JPY NZD/CAD TRY/JPY			

EUR/HUF USD/HUF USDOLLAR SP35 US30 SPX500 NAS100 UK100 GER30 FRA40			
SUI20 AUS200 EUSTX50 BUND USOIL UKOIL NGAS XAU/USD XAG/USD XPD/USD			
XPT/USD Copper			

Amennyiben az Ügyfél 12.00 óráig beutal a CODEX Tőzsdegynökség Zrt.-nél megnyitott Határidős, Opció, Deviza spot és CFD Befektetési Számlájára, úgy azt a Társaság még azon a napon továbbutalja a Végrehajtási Politikában meghatározott kereskedési helyszín felé (FXCM), azonban az Ügyfél pozíció nyitására vonatkozó megbízását kizárólag a következő kereskedési napon (T+1) fogadja.

Budapest, 2015. december 18.

Dr. Galambos Péter
vezérigazgató