

Uchwała Nr 058/26/06/2011

Zarządu Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A.

z dnia 14 czerwca 2011 roku

w sprawie wysokości współczynników ryzyka

§ 1

Zarząd Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A. (Spółka) ustala wartość współczynników ryzyka na poziomie określonym w Komunikacie nr 3 stanowiącym załącznik nr 1 do niniejszej uchwały.

§ 2

Uchwała wchodzi w życie z dniem 21 czerwca 2011 roku.

Ireneusz Łazor

Prezes Zarządu

Załącznik Nr 1 do Uchwała Nr 058/26/06/2011
Komunikat Nr 3 o wysokości współczynników ryzyka
z dnia 21 czerwca 2011 roku

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
1	27,69%	21,95%
2	21,78%	17,05%
3	18,93%	14,71%
4	17,15%	13,26%
5	15,88%	12,23%
6	14,92%	11,46%
7	14,15%	10,84%
8	13,51%	10,33%
9	12,98%	9,90%
10	12,52%	9,53%
11	12,12%	9,21%
12	11,77%	8,93%
13	11,45%	8,68%
14	11,16%	8,45%
15	10,90%	8,25%
16	10,67%	8,06%
17	10,45%	7,89%
18	10,25%	7,73%
19	10,06%	7,58%
20	9,89%	7,44%
21	9,72%	7,31%
22	9,57%	7,19%
23	9,43%	7,08%
24	9,29%	6,97%
25	9,16%	6,87%
26	9,04%	6,78%
27	8,93%	6,69%
28	8,82%	6,60%
29	8,71%	6,52%
30	8,61%	6,44%
31	8,52%	6,37%
32	8,43%	6,30%
33	8,34%	6,23%
34	8,26%	6,16%
35	8,17%	6,10%
36	8,10%	6,04%
37	8,02%	5,98%
38	7,95%	5,92%
39	7,88%	5,87%
40	7,81%	5,81%
41	7,75%	5,77%

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
42	7,69%	5,72%
43	7,62%	5,67%
44	7,57%	5,62%
45	7,51%	5,58%
46	7,45%	5,54%
47	7,40%	5,49%
48	7,35%	5,45%
49	7,30%	5,41%
50	7,25%	5,37%
51	7,20%	5,33%
52	7,15%	5,30%
53	7,10%	5,26%
54	7,06%	5,23%
55	7,02%	5,19%
56	6,97%	5,16%
57	6,93%	5,13%
58	6,89%	5,10%
59	6,85%	5,07%
60	6,81%	5,04%
61	6,78%	5,01%
62	6,74%	4,98%
63	6,70%	4,95%
64	6,67%	4,93%
65	6,63%	4,90%
66	6,60%	4,87%
67	6,56%	4,85%
68	6,53%	4,82%
69	6,50%	4,79%
70	6,47%	4,77%
71	6,44%	4,75%
72	6,41%	4,73%
73	6,38%	4,70%
74	6,35%	4,68%
75	6,32%	4,65%
76	6,29%	4,63%
77	6,26%	4,61%
78	6,24%	4,59%
79	6,21%	4,57%
80	6,18%	4,55%
81	6,16%	4,53%
82	6,13%	4,51%
83	6,11%	4,49%

Załącznik Nr 1 do Uchwała Nr 058/26/06/2011
Komunikat Nr 3 o wysokości współczynników ryzyka
z dnia 21 czerwca 2011 roku

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
84	6,08%	4,47%
85	6,06%	4,45%
86	6,03%	4,44%
87	6,01%	4,42%
88	5,99%	4,40%
89	5,97%	4,38%
90	5,94%	4,37%
91	5,92%	4,35%
92	5,90%	4,33%
93	5,88%	4,32%
94	5,86%	4,30%
95	5,84%	4,28%
96	5,82%	4,27%
97	5,80%	4,25%
98	5,78%	4,24%
99	5,76%	4,22%
100	5,74%	4,21%
101	5,72%	4,19%
102	5,70%	4,18%
103	5,68%	4,16%
104	5,66%	4,15%
105	5,64%	4,13%
106	5,62%	4,12%
107	5,61%	4,11%
108	5,59%	4,09%
109	5,57%	4,08%
110	5,56%	4,07%
111	5,54%	4,05%
112	5,52%	4,04%
113	5,51%	4,03%
114	5,49%	4,02%
115	5,47%	4,01%
116	5,46%	3,99%
117	5,44%	3,98%
118	5,43%	3,97%
119	5,41%	3,96%
120	5,40%	3,94%
121	5,38%	3,94%
122	5,37%	3,92%
123	5,35%	3,91%
124	5,34%	3,90%
125	5,32%	3,89%
126	5,31%	3,88%

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
127	5,29%	3,87%
128	5,28%	3,86%
129	5,27%	3,85%
130	5,25%	3,84%
131	5,24%	3,83%
132	5,23%	3,82%
133	5,21%	3,81%
134	5,20%	3,79%
135	5,19%	3,79%
136	5,17%	3,77%
137	5,16%	3,77%
138	5,15%	3,75%
139	5,14%	3,75%
140	5,12%	3,74%
141	5,11%	3,73%
142	5,10%	3,72%
143	5,09%	3,71%
144	5,08%	3,70%
145	5,06%	3,69%
146	5,05%	3,68%
147	5,04%	3,68%
148	5,03%	3,66%
149	5,02%	3,66%
150	5,01%	3,65%
151	5,00%	3,64%
152	4,98%	3,63%
153	4,97%	3,62%
154	4,96%	3,62%
155	4,95%	3,60%
156	4,94%	3,60%
157	4,93%	3,59%
158	4,92%	3,58%
159	4,91%	3,57%
160	4,90%	3,57%
161	4,89%	3,56%
162	4,88%	3,55%
163	4,87%	3,55%
164	4,86%	3,53%
165	4,85%	3,53%
166	4,84%	3,52%
167	4,83%	3,51%
168	4,82%	3,51%
169	4,81%	3,50%

Załącznik Nr 1 do Uchwała Nr 058/26/06/2011
Komunikat Nr 3 o wysokości współczynników ryzyka
z dnia 21 czerwca 2011 roku

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
170	4,80%	3,49%
171	4,79%	3,48%
172	4,78%	3,48%
173	4,77%	3,47%
174	4,76%	3,46%
175	4,75%	3,46%
176	4,75%	3,45%
177	4,74%	3,44%
178	4,73%	3,44%
179	4,72%	3,43%
180	4,71%	3,42%
181	4,70%	3,42%
182	4,69%	3,41%
183	4,68%	3,40%
184	4,68%	3,40%
185	4,67%	3,39%
186	4,66%	3,38%
187	4,65%	3,38%
188	4,64%	3,37%
189	4,63%	3,37%
190	4,63%	3,36%
191	4,62%	3,35%
192	4,61%	3,35%
193	4,60%	3,34%
194	4,59%	3,33%
195	4,59%	3,33%
196	4,58%	3,32%
197	4,57%	3,31%
198	4,56%	3,31%
199	4,55%	3,30%
200	4,55%	3,30%
201	4,54%	3,29%
202	4,53%	3,29%
203	4,52%	3,28%
204	4,52%	3,28%
205	4,51%	3,27%
206	4,50%	3,26%
207	4,49%	3,26%
208	4,49%	3,25%
209	4,48%	3,25%
210	4,47%	3,24%
211	4,47%	3,24%
212	4,46%	3,23%

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
213	4,45%	3,22%
214	4,45%	3,22%
215	4,44%	3,22%
216	4,43%	3,21%
217	4,42%	3,20%
218	4,42%	3,20%
219	4,41%	3,19%
220	4,40%	3,19%
221	4,40%	3,19%
222	4,39%	3,18%
223	4,38%	3,17%
224	4,38%	3,17%
225	4,37%	3,17%
226	4,36%	3,16%
227	4,36%	3,15%
228	4,35%	3,15%
229	4,35%	3,15%
230	4,34%	3,14%
231	4,33%	3,13%
232	4,33%	3,13%
233	4,32%	3,13%
234	4,31%	3,12%
235	4,31%	3,12%
236	4,30%	3,11%
237	4,30%	3,11%
238	4,29%	3,10%
239	4,28%	3,10%
240	4,28%	3,10%
241	4,27%	3,09%
242	4,27%	3,08%
243	4,26%	3,08%
244	4,25%	3,08%
245	4,25%	3,07%
246	4,24%	3,07%
247	4,24%	3,06%
248	4,23%	3,06%
249	4,23%	3,05%
250	4,22%	3,05%
251	4,21%	3,05%
252	4,21%	3,04%
253	4,20%	3,04%
254	4,20%	3,03%
255	4,19%	3,03%

Załącznik Nr 1 do Uchwała Nr 058/26/06/2011
Komunikat Nr 3 o wysokości współczynników ryzyka
z dnia 21 czerwca 2011 roku

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
256	4,19%	3,03%
257	4,18%	3,02%
258	4,18%	3,02%
259	4,17%	3,01%
260	4,17%	3,01%
261	4,16%	3,01%
262	4,15%	3,00%
263	4,15%	2,99%
264	4,14%	2,99%
265	4,14%	2,99%
266	4,13%	2,99%
267	4,13%	2,98%
268	4,12%	2,98%
269	4,12%	2,97%
270	4,11%	2,97%
271	4,11%	2,97%
272	4,10%	2,96%
273	4,10%	2,96%
274	4,09%	2,96%
275	4,09%	2,95%
276	4,08%	2,95%
277	4,08%	2,94%
278	4,07%	2,94%
279	4,07%	2,94%
280	4,06%	2,94%
281	4,06%	2,93%
282	4,05%	2,93%
283	4,05%	2,93%
284	4,04%	2,93%
285	4,04%	2,93%
286	4,03%	2,93%
287	4,03%	2,93%
288	4,03%	2,93%
289	4,02%	2,92%
290	4,02%	2,92%
291	4,01%	2,92%
292	4,01%	2,92%
293	4,00%	2,92%
294	4,00%	2,92%
295	3,99%	2,92%
296	3,99%	2,92%
297	3,98%	2,92%
298	3,98%	2,92%

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
299	3,98%	2,91%
300	3,97%	2,91%
301	3,97%	2,91%
302	3,96%	2,91%
303	3,96%	2,91%
304	3,95%	2,91%
305	3,95%	2,90%
306	3,94%	2,90%
307	3,94%	2,90%
308	3,94%	2,90%
309	3,93%	2,90%
310	3,93%	2,90%
311	3,92%	2,90%
312	3,92%	2,89%
313	3,92%	2,89%
314	3,91%	2,89%
315	3,91%	2,89%
316	3,90%	2,89%
317	3,90%	2,89%
318	3,89%	2,89%
319	3,89%	2,89%
320	3,89%	2,89%
321	3,88%	2,89%
322	3,88%	2,89%
323	3,87%	2,89%
324	3,87%	2,89%
325	3,87%	2,88%
326	3,87%	2,88%
327	3,86%	2,88%
328	3,86%	2,88%
329	3,86%	2,88%
330	3,86%	2,88%
331	3,86%	2,88%
332	3,86%	2,88%
333	3,85%	2,87%
334	3,85%	2,87%
335	3,85%	2,87%
336	3,85%	2,87%
337	3,85%	2,87%
338	3,85%	2,87%
339	3,84%	2,87%
340	3,84%	2,86%
341	3,84%	2,86%

Załącznik Nr 1 do Uchwały Nr 058/26/06/2011
Komunikat Nr 3 o wysokości współczynników ryzyka
z dnia 21 czerwca 2011 roku

Ilość dni do dostawy	Współczynnik dla kontraktów PEAK5	Współczynnik dla kontraktów BASE
342	3,84%	2,86%
343	3,84%	2,86%
344	3,83%	2,86%
345	3,83%	2,86%
346	3,83%	2,86%
347	3,83%	2,86%
348	3,83%	2,86%
349	3,83%	2,86%
350	3,82%	2,86%
351	3,82%	2,86%
352	3,82%	2,85%
353	3,82%	2,85%
354	3,82%	2,85%
355	3,82%	2,85%
356	3,82%	2,85%
357	3,81%	2,85%
358	3,81%	2,85%
359	3,81%	2,85%
360	3,81%	2,85%
361	3,81%	2,85%
362	3,81%	2,85%
363	3,80%	2,85%
364	3,80%	2,84%
od 365 do 1461	3,80%	2,84%