

**KOMUNIKAT NR 9/1
Z DNIA 28 GRUDNIA 2017 R.**



Wydany przez: **Dyrektora Domu Maklerskiego**

Dotyczy: **określenie warunków świadczenia usługi w zakresie wykonywania zleceń nabycia lub zbycia Derywatów oraz związanych z tą usługą depozytów zabezpieczających**

Na podstawie § 61 ust. 3, § 62 ust. 1, § 64 ust. 1 i 3, § 67 ust. 1, § 68 ust. 2, § 69 ust. 4 „Regulaminu świadczenia usług maklerskich przez Dom Maklerski PKO Banku Polskiego” ustala się, co następuje:

1. Określa się następujące wysokości wskaźników zabezpieczających na rynku instrumentów pochodnych:
 - 1) Dla kontraktów terminowych:
 - a) właściwy depozyt zabezpieczający – w wysokości określonej przez KDPW S.A.,
 - b) wstępny depozyt zabezpieczający – w wysokości równej 120% wartości właściwego depozytu zabezpieczającego określonego przez KDPW S.A., przy czym wartość wstępnego depozytu zabezpieczającego określoną w procentach wylicza się z dokładnością do jednego miejsca po przecinku.
 - 2) Dla opcji oraz jednostek indeksowych:
 - a) właściwy depozyt zabezpieczający – w wysokości określonej przez KDPW S.A.,
 - b) wstępny depozyt zabezpieczający – w wysokości równej 120% wartości właściwego depozytu zabezpieczającego określonego przez KDPW S.A., przy czym wartość wstępnego depozytu zabezpieczającego określoną w procentach wylicza się z dokładnością do jednego miejsca po przecinku.
2. Zabezpieczenie na rynku instrumentów pochodnych uzupełnia się do poziomu wstępnego depozytu zabezpieczającego.
3. Depozyt zabezpieczający może być wniesiony wyłącznie w środkach pieniężnych.
4. DM PKO BP oczekuje na środki finansowe niezbędne do uzupełnienia depozytu zabezpieczającego nie później niż do godziny 10.00 następnego dnia sesyjnego po wystąpieniu spadku depozytu. Po tej godzinie DM PKO BP przystąpi do interwencyjnego zamykania pozycji. Zamknięcie pozycji przez DM PKO BP następuje w terminie i na warunkach wybranych przez DM PKO BP.
5. Wprowadza się maksymalne limity ilościowe dla następujących rodzajów zleceń:
 - 1) zlecenie na kontrakty terminowe - 100 sztuk,
 - 2) zlecenie na opcje - 100 sztuk,
 - 3) zlecenia DDM na kontrakty terminowe - 100 sztuk.
6. Wprowadza się maksymalne limity ilościowe otwartych pozycji w derywatach w ramach jednego portfela:
 - 1) limit wynosi 50 sztuk.
 - 2) możliwość otwarcia pozycji powyżej ustalonego limitu wymaga indywidualnej decyzji DM PKO BP.
7. DM PKO BP nie przyjmuje zleceń nabycia opcji bez określenia limitu ceny.
8. Przystaje obowiązywać Komunikat nr 9/4 z dnia 2 lutego 2016 r.
9. Komunikat obowiązuje od dnia 3 stycznia 2018 r.

Dyrektor Domu Maklerskiego
PKO Banku Polskiego

Filip Paszke