

Wydany przez: Dyrektora Biura Maklerskiego

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

1. Dla instrumentów pochodnych (derywatów), określamy wysokość wskaźników zabezpieczających:
 - a) właściwy depozyt zabezpieczający, który jest sumą depozytu zabezpieczającego SPAN® oraz depozytów dodatkowych add-on, na które składają się: depozyt zabezpieczający ryzyko korelacji (WWR) oraz depozyt zabezpieczający ryzyko płynności i koncentracji (LCR) – w wysokości określonej przez KDPW SA,
 - b) wstępny depozyt zabezpieczający – w wysokości równej 120% wartości depozytu zabezpieczającego SPAN®, określonego przez KDPW SA. Wartość wstępnego depozytu zabezpieczającego wyrażoną w procentach wyliczamy z dokładnością do jednego miejsca po przecinku.
2. Zabezpieczenie dla instrumentów pochodnych musisz uzupełnić do poziomu wstępnego depozytu zabezpieczającego.
3. Depozyty dodatkowe add-on (WWR i LCR) są przez nas pokrywane z własnych pieniędzy.
4. Depozyt zabezpieczający możesz uzupełnić wyłącznie pieniędzmi, które są zaksięgowane na rachunku inwestycyjnym.
5. Pieniądze, które są niezbędne do uzupełnienia depozytu zabezpieczającego musisz zapewnić na rachunku inwestycyjnym do godziny 10:00 następnego dnia sesyjnego po dniu, w którym wystąpił spadek depozytu. Jeśli do tego czasu nie uzupełnisz depozytu, przystąpimy do interwencyjnego zamykania Twoich pozycji. Zamknięcie pozycji wykonamy na określonych przez nas terminie i warunkach.
6. Maksymalne limity ilościowe dla zleceń:
 - 1) na kontrakty terminowe - 100 sztuk,
 - 2) na opcje - 100 sztuk,
 - 3) DDM na kontrakty terminowe – 100 sztuk.
7. Maksymalny limit otwartych pozycji w derywatach w ramach jednego portfela: 50 sztuk. Możesz zwiększyć ten limit, jeśli wyrazimy na to zgodę, w ramach indywidualnej decyzji.
8. Nie przyjmujemy zleceń nabycia opcji bez określenia limitu ceny (PKC, PCR, PEG).
9. Przeszaje obowiązywać Komunikat nr 9/5 z dnia 26 czerwca 2025 r. wydany na podstawie Regulaminu świadczenia usług maklerskich przez Biuro Maklerskie PKO Banku Polskiego, który obowiązywał do 1 marca 2026 r.
10. Postanowienia Komunikatu 9/1 obowiązuje od dnia 2 marca 2026 r.

Podstawa:

Rozdział 10 pkt 3, 7, 11, 13, 25, 28 oraz 35 Regulaminu świadczenia usług maklerskich przez Biuro Maklerskie PKO Banku Polskiego

Dyrektor Biura Maklerskiego
PKO Banku Polskiego

Samer Masri