



Bank Polski

WYSOKOŚĆ DEPOZYTU GWARANCYJNEGO PRZY ZAWIERANIU TRANSAKCJI NA INSTRUMENTACH POCHODNYCH

Informujemy, że kwota depozytu gwarancyjnego stanowiącego zabezpieczenie ewentualnych należności PKO Banku Polskiego S.A. (Bank) powstałych w wyniku zawarcia:

1. Negocjowanej transakcji FX Swap w Banku od 27 czerwca 2022r. wynosi:

Termin realizacji transakcji FX Swap										
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od kwoty nominalu transakcji przekazywanego przez Klienta	do 7 dni*	do 14 dni*	do 1 m-ca*	od 1 do 3 m-cy*	od 3 do 6 m-cy*	od 6 do 12 m-cy*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 4 lat*	od 4 do 5 lat*
	3,4 %	4,8%	5,9%	8,3%	11%	17%	24%	30%	33%	35%

*włącznie

2. Negocjowanej, terminowej transakcji wymiany walut wymienialnych w Banku od 27 czerwca 2022r. wynosi:

Termin realizacji transakcji terminowej											
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od kwoty nominalu transakcji przekazywanego przez Klienta	do 7 dni*	do 14 dni*	do 1 miesiąca*	od 1 do 3 m-cy*	od 3 do 6 m-cy*	od 6 do 12 m-cy*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 4 lat*	od 4 do 5 lat*	od 5 do 6 lat*
	3,4 %	4,8%	5,9%	8,3%	11%	17%	24%	30%	33%	35%	48%

*włącznie

3. Terminowej transakcji stopy procentowej FRA w Banku od 27 czerwca 2022r. wynosi:

Długość okresu wstępnego terminowej transakcji stopy procentowej FRA					
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od nominalu transakcji	do 1 miesiąca*	od 1 do 3 miesięcy*	od 3 do 6 miesięcy*	od 6 miesięcy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*
	0,3%	0,4%	0,5%	0,7%	1,0%

*włącznie

4. Transakcji zamiany stóp procentowych IRS w Banku od 27 czerwca 2022r. wynosi:

Termin zakończenia transakcji IRS											
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od nominalu transakcji	od 1 do 3 m-cy*	od 3 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 4 lat*	od 4 do 5 lat*	od 5 do 7 lat*	od 7 do 10 lat*	od 10 do 15 lat*	od 15 do 20 lat*	od 20 do 30 lat*
	0,9%	1,8%	3,3%	5,5%	7,6%	9,0%	12,9%	19,9%	32,9%	46,4%	75,5%

*włącznie

5. Transakcji opcji walutowej w Banku od 27 czerwca 2022r. wynosi:

Termin realizacji opcji walutowej											
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od kwoty nominalu transakcji przekazywanego przez Klienta albo od kwoty premii:	do 7 dni*	od 7 do 14 dni*	od 14 dni do 1 m-ca*	od 1 do 3 m-cy*	od 3 do 6 m-cy*	od 6 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 4 lat*	od 4 do 5 lat*	od 5 do 6 lat*
europejskiej opcji walutowej, europejskiej walutowej opcji barierowej, walutowej opcji azjatyckiej lub amerykańskiej opcji walutowej	1%	2%	3%	4%	5%	8%	11%	14%	15%	16%	22%
amerykańskiej walutowej opcji binarnej lub europejskiej walutowej opcji binarnej	100% kwoty nominalnej opcji pomniejszonej o kwotę zablokowanej premii										

*włącznie

6. Walutowej transakcji zamiany stóp procentowych CIRS w Banku od 27 czerwca 2022r. wynosi:

Termin zakończenia transakcji CIRS z wymianą wartości nominalnej							
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od kwoty nominalu transakcji przekazywanego przez Klienta	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 4 lat*	od 4 do 5 lat*	od 5 do 7 lat*	od 7 do 10 lat*	od 10 do 15 lat*
	38%	47%	56%	64%	83%	118%	211%

*włącznie

Termin zakończenia transakcji CIRS bez wymiany wartości nominalnej							
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od kwoty nominalu transakcji przekazywanego przez Klienta	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 4 lat*	od 4 do 5 lat*	od 5 do 7 lat*	od 6 do 10 lat*	od 10 do 15 lat*
	2,2%	4,1%	6,2%	8,3%	12,6%	19,3%	31,3%

*włącznie

7. Transakcji opcji na stopę procentową w Banku od 27 czerwca 2022r. wynosi:

Termin realizacji transakcji opcji na stopę procentową									
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego, liczona od kwoty nominalu transakcji przekazywanego przez Klienta albo od kwoty premii	do 1 m-ca*	od 1 do 3 m-cy*	od 3 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 4 lat*	od 4 do 5 lat*	od 5 do 7 lat*	od 7 do 10 lat*
	0,4%	0,7%	1,5%	2,7%	4,5%	6,2%	7,4%	10,6 %	16,3%

*włącznie

8. Transakcji swapa towarowego w Banku od 14 listopada 2022r. wynosi:

Termin realizacji transakcji swapa towarowego							
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od nominalu zawartej transakcji przemnożonego przez cenę stałą towarowych instrumentów pochodnych z zastrzeżeniem Ad. 8.A-8.B		do 1 m-ca*	od 1 do 3 m-cy*	od 3 do 6 m-cy*	od 6 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*
1.	ołów	15%	26%	37%	53%	76%	96%
2.	nikiel	16%	30%	44%	66%	92%	-
3.	pszenica	15%	24%	35%	48%	67%	-
4.	cyna	14%	23%	34%	47%	68%	-
5.	cynek	14%	25%	36%	47%	68%	92%
6.	miedź	16%	27%	38%	51%	79%	-
7.	ropa Brent • Platts Dated Brent • ICE Closing Price	22%	40%	54%	74%	113%	141%
8.	kukurydza	15%	27%	35%	51%	68%	-
9.	aluminium	11%	20%	28%	39%	56%	68%
10.	stop aluminium	12%	21%	29%	41%	55%	-
11.	rzepak	12%	19%	28%	40%	55%	-
12.	olej opałowy Gasoil	17%	28%	40%	62%	86%	-
13.	olej napędowy Fuel Oil 1%	22%	37%	49%	81%	124%	-
14.	olej napędowy Fuel Oil 3,5%	23%	40%	57%	83%	112%	-
15.	diesel ULSD	20%	31%	48%	63%	86%	-
16.	gaz naturalny: • TTF Argus, • Argus Germany VTP	43%	71%	103%	160%	226%	260%
17.	gaz naturalny ICE UK Natural GAS NBP	33%	57%	83%	127%	187%	219%
18.	nafta Naphtha	23%	41%	56%	88%	122%	-
19.	cukier	15%	25%	36%	48%	73%	-
20.	paliwo lotnicze JET Barges FOB Rotterdam	22%	33%	48%	63%	98%	-
21.	węgiel: • TSI FOB Australia Hard Coking Coal • API2	24% 27%	34% 46%	48% 65%	69% 99%	102% 153%	127% 186%
22.	łosoś	27%	43%	65%	97%	120%	-

23.	gaz naturalny Henry Hub	31%	53%	75%	113%	165%	203%
24.	Marine Fuel 0.5% FOB Barges Rotterdam	29%	47%	70%	102%	143%	-
25.	paliwo lotnicze Jet CIF NWE Cargo	21%	34%	47%	70%	104%	133%

*włącznie

8.A. Dla transakcji, w której Klient płaci cenę stałą do wyliczenia kwoty depozytu gwarancyjnego stosowana jest niższa z dwóch wartości: wskaźnik wskazany dla odpowiedniego towaru w tabeli 8 lub 100%.

8.B. Dla transakcji, w której wymiana następuje w oparciu o dwie kwoty zmienne, kwota depozytu gwarancyjnego wyznaczana jest jako wskaźnik wskazany dla odpowiedniego towaru w tabeli 8 przemnożony przez estymowaną wycenę z momentu zawarcia transakcji kwoty zmiennej płaconej przez Bank.

9. Transakcji opcji towarowej w Banku od 14 listopada 2022r. wynosi:

Termin realizacji transakcji opcji towarowej							
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od nominalu zawartej transakcji przemnożonego przez cenę stałą towarowych instrumentów pochodnych		do 1 m-ca*	od 1 do 3 m-cy*	od 3 do 6 m-cy*	od 6 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*
1.	Dated Brent	22%	40%	54%	74%	113%	141%
2.	paliwo lotnicze Jet CIF NWE Cargo	21%	34%	47%	70%	104%	133%
3.	TSI Premium Hard Coking Coal	24%	34%	48%	69%	102%	127%

*włącznie

10. Transakcji na rynku uprawnień do emisji gazów cieplarnianych od 14 listopada 2022r. wynosi:

Termin realizacji transakcji na rynku uprawnień do emisji gazów cieplarnianych								
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od nominalu zawartej transakcji przemnożonego przez cenę stałą instrumentów pochodnych z zastrzeżeniem Ad 10.A - 10.D		do 1 tygodnia*	do 1 m-ca*	od 1 do 3 m-cy*	od 3 do 6 m-cy*	od 6 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*
1.	prawa do emisji CO ₂	18%	26%	43%	60%	89%	132%	163%

*włącznie

10.A. Dla transakcji z rozliczeniem pieniężnym, w której Klient płaci cenę stałą do wyliczenia kwoty depozytu gwarancyjnego zastosowana zostanie niższa z dwóch wartości: wskaźnik wynikający z tabeli 10 lub 100%

10.B. Dla transakcji z rozliczeniem fizycznym, w której Klient kupuje uprawnienia na CO₂ i data płatności wypada najpóźniej w dacie dostawy do wyliczenia kwoty depozytu gwarancyjnego użyta zostanie niższa z dwóch wartości: wskaźnik wynikający z tabeli 10 lub 100%.

10.C. Dla transakcji z rozliczeniem fizycznym, w której Klient kupuje uprawnienia na CO₂ i data płatności wypada później niż data dostawy uprawnień, wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego jest ustalona jako nominal zawartej transakcji przemnożony przez cenę stałą niezależnie od terminu realizacji transakcji.

10.D. Dla transakcji z rozliczeniem fizycznym, w której Klient sprzedaje uprawnienia na CO₂ i data dostawy uprawnień wypada później niż data płatności, wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego jest ustalona jako nominal zawartej transakcji przemnożony przez cenę stałą oraz 100% powiększone o wskaźnik wynikający z tabeli 10.