

**w sprawie wysokości depozytu gwarancyjnego przy zawieraniu transakcji na instrumentach pochodnych**

Informujemy, że kwota depozytu gwarancyjnego stanowiącego zabezpieczenie ewentualnych należności Banku powstałych w wyniku zawarcia:

1. Negocjowanej transakcji FX Swap w Banku od 30 października 2018 r. 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%	5%	7%	10%	13%	19%	22%	25%	31%

*włącznie

2. Negocjowanej, terminowej transakcji wymiany walut wymienialnych w Banku od 30 października 2018 r. 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 miesi- qca*	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 6 lat*
	3%	4%	5%	7%	10%	13%	19%	22%	25%	31%

*włącznie

3. Terminowej transakcji stopy procentowej FRA w Banku od 1 września 2013 r. wynosi:

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

*włącznie

4. Transakcji zamiany stóp procentowych IRS w Banku od 19 stycznia 2018 r. wynosi:

Termin zakończenia transakcji IRS										
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od nominalu transakcji	od 1 do 3 miesięcy*	od 3 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 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*
	1%	3%	5%	5,5%	6%	6,5%	7%	11%	16%	24%

*włącznie

5. Transakcji opcji walutowej w Banku od 30 października 2018 r. 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 6 lat*
europejskiej opcji walutowej, europejskiej walutowej opcji barierowej, walutowej opcji azjatyckiej lub amerykańskiej opcji walutowej	3%	4%	5%	7%	10%	14%	20%	25%	27%	33%
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 1 września 2013 r. 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 5 lat*	od 5 do 7 lat*	od 7 do 10 lat*	od 10 do 15 lat*	
		21%	24%	31%	34%	42%	50%

*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 6 lat*	od 6 do 10 lat*	od 10 do 15 lat*	
		1,5%	2,6%	3,8%	6,9%	14,8%	29,3%

*włącznie

7. Transakcji opcji na stopę procentową w Banku od 26 marca 2019 r. 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 3 m-cy*	od 3 m-cy do 1 roku*	od 1 do 2 lat*	od 2 do 3 lat*	od 3 do 5 lat*	od 5 do 7 lat*	od 7 do 10 lat*
		1%	3%	5%	5,5%	6%	6,5%

*włącznie

8. Transakcji swapa towarowego w Banku od 9 marca 2020 r. wynosi:

Termin realizacji transakcji swapa towarowego							
Wysokość kwoty depozytu gwarancyjnego liczona od nominału 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	11%	17%	25%	30%	45%	58%
2.	nikiel	13%	16%	24%	25%	39%	-
3.	pszenica	15%	26%	35%	66%	407%	-
4.	cynga	14%	15%	25%	42%	76%	-
5.	cynek	12%	20%	32%	54%	94%	94%
6.	miedź	11%	15%	16%	19%	55%	-
7.	ropa Brent • Platts Dated Brent • ICE Closing Price	20%	35%	41%	46%	91%	137%
8.	kukurydza	12%	15%	20%	28%	97%	-
9.	aluminium	9%	13%	24%	29%	38%	48%
10.	stop aluminium	10%	12%	15%	26%	48%	-
11.	rzepak	10%	14%	24%	58%	177%	-
12.	olej opałowy Gasoil	10%	17%	25%	50%	90%	-
13.	olej napędowy Fuel Oil 1%	12%	18%	25%	58%	83%	-
14.	olej napędowy Fuel Oil 3,5%	12%	18%	25%	58%	82%	-
15.	diesel ULSD	11%	17%	25%	53%	96%	-
16.	gaz naturalny: • Gaspool Argus, • Gaspool ICE, • NCG Argus, • ICE UK Natural GAS NBP, • TTF Argus	20%	29%	35%	66%	125%	143%
17.	nafta Naphtha	15%	16%	18%	19%	58%	-
18.	cukier	14%	21%	31%	44%	48%	-
19.	paliwo lotnicze	13%	23%	28%	31%	72%	-
20.	węgiel: • TSI FOB Australia Hard Coking Coal • API2	30% 13%	46% 25%	86% 38%	173% 64%	175% 94%	178% 121%
21.	łosoś	24%	42%	53%	63%	87%	-
22.	Gaz naturalny Henry Hub	27%	44%	53%	64%	105%	142%
23.	Marine Fuel 0.5% FOB Barges Rotterdam	10%	17%	25%	50%	90%	-

*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 7 sierpnia 2019 r. 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	19,9%	34,4%	38,5%	53,6%	72,2%	120,0%
2.	paliwo lotnicze Jet CIF NWE Cargo	16,1%	29,4%	33,6%	48,7%	69,3%	96,2%
3.	TSI Premium Hard Coking Coal	30%	46%	86%	173%	175%	178%

*włącznie

10. Transakcji na rynku uprawnień do emisji gazów cieplarnianych od 31 lipca 2020 r. 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	15%	29%	52%	74%	112%	176%	244%

*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.

Postanowienia niniejszego Komunikatu mają zastosowanie od dnia 31 lipca 2020 r.