

## **Komunikat nr 260**

### **Domu Maklerskiego Banku BPS S.A.**

#### **w sprawie wysokości wymaganego depozytu zabezpieczającego oraz określenia zasad naliczania środków stanowiących zabezpieczenie realizacji zobowiązań wynikających z derywatów.**

Na podstawie § 87, § 88 i § 89 Regulaminu świadczenia usług maklerskich przez Dom Maklerski Banku BPS Spółka Akcyjna ustala się, co następuje:

#### **§ 1**

1. Depozyt zabezpieczający dla derywatów jest ustalany przy wykorzystaniu metodologii „SPAN” (The Standard Portfolio Analysis Of Risk), o której mowa w Szczegółowych Zasadach Prowadzenia Rozliczeń Transakcji (obróć zorganizowany) wydanych przez KDPW\_CCP S.A..
2. Klient zobowiązany jest do utrzymania depozytu zabezpieczającego od otwartych na Rachunku pozycji w derywatach w wysokości 100 % depozytu obliczonego w oparciu o aktualne parametry ryzyka określone przez KDPW\_CCP S.A..
3. Składając zlecenie otwierające pozycje w derywatach, Klient zobowiązany jest wnieść depozyt zabezpieczający nie niższy od poziomu określonego w ust. 2.
4. W przypadku składania zlecenia zwiększającego ilość pozycji w derywatach na rachunku Klienta, na którym otwarte są już inne pozycje w derywatach, Klient zobowiązany jest uzupełnić depozyt zabezpieczający od wszystkich posiadanych pozycji w portfelu do wysokości depozytu określonej w ust. 2 z zastrzeżeniem ust. 5.
5. Przy składaniu przez Klienta zleceń na derywaty podczas sesji, Dom Maklerski obliczając depozyt zabezpieczający dla nowo otwartych pozycji uwzględnia zyski i straty z tytułu zrealizowanych transakcji zamknięcia pozycji w derywatach w danym dniu.
6. Jeżeli wartość depozytu spadnie poniżej poziomu określonego w ust. 2, Klient zobowiązany jest uzupełnić depozyt zabezpieczający co najmniej do tego poziomu, nie później niż na 15 minut przed rozpoczęciem notowań derywatów w dniu następującym po dniu, w którym nastąpił spadek depozytu zabezpieczającego określonego w ust. 2.

#### **§ 2**

Depozyt zabezpieczający może być wnoszony tylko w środkach pieniężnych.

**Komunikat wchodzi z dniem 22.10.2018 r.**

**Traci moc Komunikat nr 200 z dnia 10.04.2015 r.**