

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 2022 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%	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 5 lipca 2023 r. 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%	0,6%	1,0%	1,6%	2,1%

* 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%

*włącznie

8. Transakcji swapa towarowego w Banku od 9 lutego 2024 r. 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%	212%
3.	pszenica	15%	24%	35%	48%	67%	84%
4.	cyna	14%	23%	34%	47%	68%	88%
5.	cynk	14%	25%	36%	47%	68%	92%
6.	miedź	16%	27%	38%	51%	79%	88%
ropa Brent:							
7.	<ul style="list-style-type: none"> • Platts Dated Brent • ICE Closing Price 	22%	40%	54%	74%	113%	141%
8.	kukurydza	15%	27%	35%	51%	68%	83%
9.	aluminium	12%	21%	29%	40%	61%	71%
10.	stop aluminium	12%	21%	29%	41%	55%	66%
11.	rzepak	13%	22%	34%	45%	64%	74%
12.	olej opałowy Gasoil	17%	28%	40%	62%	86%	107%
13.	olej napędowy Fuel Oil 1%	22%	37%	49%	81%	124%	133%
14.	olej napędowy Fuel Oil 3,5%	23%	40%	57%	83%	112%	156%
15.	diesel ULSD	20%	31%	48%	63%	86%	113%
gaz naturalny:							
16.	<ul style="list-style-type: none"> • TTF Argus, • Argus Germany VTP 	49%	87%	138%	200%	272%	298%
17.	gaz naturalny ICE UK Natural GAS NBP	33%	57%	83%	127%	187%	219%
18.	nafta Naphta	23%	41%	56%	88%	122%	145%
19.	cukier	15%	25%	36%	48%	73%	87%
20.	paliwo lotnicze JET Barges FOB Rotterdam	22%	33%	48%	63%	98%	125%
węgiel:							
21.	<ul style="list-style-type: none"> • TSI FOB Australia Hard Coking Coal • API2 	24%	34%	48%	69%	102%	127%
		27%	46%	65%	99%	153%	186%

22.	łosoś	27%	43%	65%	97%	120%	173%
23.	gaz naturalny Henry Hub	31%	53%	75%	113%	165%	203%
24.	Marine Fuel 0.5% FOB Barges Rotterdam	29%	47%	70%	102%	143%	179%
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 2022 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	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 2022 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	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 nominalna wartość zawartej transakcji pomnożony 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 nominalna wartość zawartej transakcji pomnożony przez cenę stałą oraz 100% powiększone o wskaźnik wynikający z tabeli 10.

Postanowienia niniejszego Komunikatu mają zastosowanie od dnia 9 lutego 2024 r.