

LISTA TOWARÓW BAZOWYCH, CEN REFERENCYJNYCH I MINIMALNYCH NOMINAŁÓW DLA TOWAROWYCH TRANSAKCYJ POCHODNYCH ORAZ TRANSAKCYJ NA RYNKU UPRAWNIENI DO EMISJI GAZÓW CIPELARNIANYCH W PKO BANKU POLSKIM SA OBOWIĄZUJĄCA OD DNIA 15 LUTEGO 2024r.



Bank Polski

Informujemy, że od dnia 15 lutego 2024r. Bank przeprowadza transakcje dla następujących towarów, cen referencyjnych oraz minimalnych nominałów w zakresie:

• dotyczy transakcji swapa towarowego:

Grupa	Nazwa	Cena referencyjna, sposób ustalania i źródło ceny	Czas publikacji	Waluta	Minimalny nominał transakcji	Jednostka miary	Sposób zamknięcia	Data rozliczenia <sup>1</sup>
METALE BAZOWE	Aluminium	ALUMINIUM-LME CASH; ALUMINIUM-LME CASH, ECB FX fixing; ALUMINIUM-LME CASH, NBP FX fixing; ALUMINIUM-LME 3 MONTH; ALUMINIUM-LME 3 MONTH, ECB FX fixing; ALUMINIUM-LME 3 MONTH, NBP FX fixing; ALUMINIUM-LME CASH, LME FX fixing; ALUMINIUM-LME 3 MONTH, LME FX fixing	13:00 GMT	USD, EUR, PLN	25	tona metryczna	do fixingu <sup>2</sup>	2. dzień roboczy towaru po ostatnim dniu obserwacji
	Stop aluminium	ALUMINIUM ALLOY-LME CASH; ALUMINIUM ALLOY-LME CASH, ECB FX fixing; ALUMINIUM ALLOY-LME CASH, NBP FX fixing; ALUMINIUM ALLOY-LME 3 MONTH; ALUMINIUM ALLOY-LME 3 MONTH, ECB FX fixing; ALUMINIUM ALLOY-LME 3 MONTH, NBP FX fixing; ALUMINIUM ALLOY-LME CASH, LME FX fixing; ALUMINIUM ALLOY-LME 3 MONTH, LME FX fixing	12:40 GMT		20			
	Miedź	COPPER-LME CASH; COPPER-LME CASH, ECB FX fixing; COPPER-LME CASH, NBP FX fixing; COPPER-LME 3 MONTH; COPPER-LME 3 MONTH, ECB FX fixing; COPPER-LME 3 MONTH, NBP FX fixing; COPPER-LME CASH, LME FX fixing; COPPER-LME 3 MONTH, LME FX fixing	12:35 GMT		25			
	Cynk	ZINC-LME CASH; ZINC-LME CASH, ECB FX fixing; ZINC-LME CASH, NBP FX fixing; ZINC-LME 3 MONTH; ZINC-LME 3 MONTH, ECB FX fixing; ZINC-LME 3 MONTH, NBP FX fixing; ZINC-LME CASH, LME FX fixing;	12:55 GMT					

		ZINC-LME 3 MONTH, LME FX fixing						
	Ołów	LEAD-LME CASH; LEAD-LME CASH, ECB FX fixing; LEAD-LME CASH, NBP FX fixing; LEAD-LME 3 MONTH; LEAD-LME 3 MONTH, ECB FX fixing; LEAD-LME 3 MONTH, NBP FX fixing; LEAD-LME CASH, LME FX fixing; LEAD-LME 3 MONTH, LME FX fixing	12:50 GMT					
	Nikiel	NICKEL-LME CASH; NICKEL-LME CASH, ECB FX fixing; NICKEL-LME CASH, NBP FX fixing; NICKEL-LME 3 MONTH; NICKEL-LME 3 MONTH, ECB FX fixing; NICKEL-LME 3 MONTH, NBP FX fixing; NICKEL-LME CASH, LME FX fixing; NICKEL-LME 3 MONTH, LME FX fixing	13:05 GMT		6			
	Cyna	TIN-LME CASH; TIN-LME CASH, ECB FX fixing; TIN-LME CASH, NBP FX fixing; TIN-LME 3 MONTH; TIN-LME 3 MONTH, ECB FX fixing; TIN-LME 3 MONTH, NBP FX fixing; TIN-LME CASH, LME FX fixing; TIN-LME 3 MONTH, LME FX fixing	12:45 GMT		5			
ENERGIA	Oil Brent ICE	OIL BRENT ICE (B); OIL BRENT ICE (B), NBP FX fixing	19:30 GMT	USD, PLN	1 000	baryłka	do fixingu <sup>2</sup>	5. dzień roboczy towaru po ostatnim dniu obserwacji
	Dated Brent Platts	OIL-BRENT (DTD)-PLATTS MARKETWIRE OIL-BRENT (DTD)-PLATTS MARKETWIRE, HIGH <sup>4</sup>	16:30 GMT	USD,			do fixingu <sup>2</sup>	
	Gasoil	GAS OIL - ICE FUTURES; GAS OIL - ICE FUTURES, NBP FX fixing	19:30 GMT				do fixingu <sup>2</sup>	
	Gasoil	Gasoil 0.1% FOB Barges Rotterdam Platts Unweighted Average (Platts code AAYWT00); Gasoil 0.1% FOB Barges Rotterdam Platts (Platts code AAYWT00), HIGH <sup>4</sup> ; Gasoil 0.1% FOB Barges Rotterdam Platts Unweighted Average (Platts code AAYWT00), NBP FX fixing	16:30 GMT	USD, PLN	100	tona metryczna	do fixingu <sup>2</sup>	
	Gasoil	Gasoil 0.1% CIF NWE Cargoes Platts Unweighted Average (Platts code AAYWS00); Gasoil 0.1% CIF NWE Cargoes Platts (Platts code AAYWS00), HIGH <sup>4</sup> ;  Gasoil 0.1% CIF NWE Cargoes Platts Unweighted Average (Platts code AAYWS00), NBP FX fixing						
	Gas naturalny TTF Month Ahead	Natural Gas TTF Month Ahead Unweighted Average Price Argus Nat Gas		EUR	10 000	MWh		

	Gaz naturalny TTF Day Ahead	Natural Gas TTF Day Ahead and Weekend Unweighted Average Price - Argus European Nat Gas	16:30 GMT <sup>3</sup>					
	Gaz naturalny Germany VTP Day Ahead	Germany VTP (Trading Hub Europe) Day-Ahead, Argus Settlement Price	16:30 GMT	EUR	10 000	MWh <sup>1</sup>		
	Gaz naturalny Germany VTP Front Month	Germany VTP (Trading Hub Europe) Front-Month, Argus Settlement Price	16:30 GMT	EUR	10 000	MWh		
	Gaz naturalny Henry Hub	Natural Gas - Henry Hub - Last Day Financial Futures Contract NYMEX	16:00 CT	USD	10 000	MMBtu		
	Fuel Oil 1%	FUEL OIL-1 PERCENT-BARGES FOB ROTTERDAM PLATTS EUROPEAN (Platts code PUAAP00); FUEL OIL-1 PERCENT-BARGES FOB ROTTERDAM PLATTS EUROPEAN (Platts code PUAAP00), NBP FX fixings	16:30 GMT					
	Fuel Oil 1%	FUEL OIL-1 PERCENT-CARGOES FOB NWE-PLATTS EUROPEAN (Platts code PUAAM00); FUEL OIL-1 PERCENT-CARGOES FOB NWE-PLATTS EUROPEAN (Platts code PUAAM00), NBP FX fixing	16:30 GMT					
	Fuel Oil 3,5%	FUEL OIL-3.5-BARGOES FOB ROTTERDAM-PLATTS EUROPEAN (Platts code PUABC00); FUEL OIL-3.5-BARGOES FOB ROTTERDAM-PLATTS EUROPEAN (Platts code PUABC00), NBP FX fixings	16:30 GMT					
	Fuel Oil 3,5%	FUEL OIL-3.5 PERCENT-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATSS EUROPEAN (Platts code PUABA00); FUEL OIL-3.5 PERCENT-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATSS EUROPEAN (Platts code PUABA00), NBP FX fixing	16:30 GMT	USD, PLN	100	tona metryczna		
	Diesel ULSD 10 PPM FOB ARA Rotterdam	ULTRA LOW SULPHUR DIESEL-BARGES FOB ROTTERDAM 10 PPM-PLATTS EUROPEAN (Platts code AAJUS00); ULTRA LOW SULPHUR DIESEL-BARGES FOB ROTTERDAM 10 PPM-PLATTS EUROPEAN (Platts code AAJUS00), HIGH <sup>4</sup> ;  ULTRA LOW SULPHUR DIESEL-BARGES FOB ROTTERDAM 10 PPM-PLATTS EUROPEAN (Platts code AAJUS00), NBP FX fixing	16:30 GMT					
	Diesel ULSD 10 PPM NWE CIF Cargo	10PPM ULTRA LOW SULPHUR DIESEL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code AAVBG00); 10PPM ULTRA LOW SULPHUR DIESEL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code AAVBG00), HIGH <sup>4</sup> ;	16:30 GMT					

		10PPM ULTRA LOW SULPHUR DIESEL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code AAVBG00), NBP FX fixing						
Paliwo lotnicze Jet Barges FOB Rotterdam		JET FUEL-BARGES FOB ROTTERDAM-PLATTS EUROPEAN (Platts code PJABA00); JET FUEL-BARGES FOB ROTTERDAM-PLATTS EUROPEAN (Platts code PJABA00), NBP FX fixing	16:30 GMT					
Paliwo lotnicze Jet Cargoes CIF NWE		JET FUEL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code PJAAU00); JET FUEL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code PJAAU00), NBP FX fixing	16:30 GMT					
Brytyjski gaz naturalny ICE UK Natural GAS NBP		Natural Gas UK Monthly ICE	16:15 GMT	GBP	1 000	Therms (1therm= 29,3071 kilowatogo dzin) na okres rozliczenio wy	do fixingu <sup>2</sup>	
Nafta		NAPHTA PHYSICAL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code PAAAL00); NAPHTA PHYSICAL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code PAAAL00), NBP FX fixingnew	16:30 GMT	USD, PLN	100	tona metryczna	do fixingu <sup>2</sup>	
Węgiel TSI Coking Coal		Platts Settlement Price - TSI Premium Hard Coking Coal Australia Export FOB East Coast Port (Platts code TS01034)	10:30 GMT	USD	1 000	tona		
Coal API2 Current Month Average		COAL-API2-ARGUS/MCCLOSKEY'S	17:30 GMT ostatni dzień roboczy miesiąca					
Coal API2 CIF ARA Weekly Index		Argus/Mc Closkey Settlement Price - Coal API2 CIF ARA Weekly Average	17:30 GMT ostatni dzień roboczy tygodnia	USD	1 000	tona metryczna	do fixingu <sup>2</sup>	
Coal API2 CIF ARA Daily Index		Argus/Mc Closkey Settlement Price - Coal API2 CIF ARA Daily Index	17:30 GMT					

	Marine Fuel	Marine Fuel 0.5% FOB Barges Rotterdam, Platts	16:30 GMT	USD	100	tona metryczna	do fixingu <sup>2</sup>	5. dzień roboczy towaru po ostatnim dniu obserwacji
PRODUKTY ROLNE	Rzepak	RAPSEED EURONEXT; RAPSEED EURONEXT, NBP FX fixing	18:30 CET	EUR, PLN	50	tona metryczna	do fixingu <sup>2</sup>	5. dzień roboczy towaru po ostatnim dniu obserwacji
	Pszenvica	MILLING WHEAT EURONEXT; MILLING WHEAT EURONEXT, NBP FX fixing	18:30 CET					
	Kukurydza	MAIZE EURONEXT; MAIZE EURONEXT, NBP FX fixing	18:30 CET					
	Cukier White Sugar	WHITE SUGAR - EURONEXT LIFFE (ICE); WHITE SUGAR - EURONEXT LIFFE (ICE), NBP FX fixing	18:00 GMT	USD, PLN, EUR	tona metryczna			
	Łosoś	Fish Pool Weekly Index Fresh Salmon SUP3-6 kg	10:00 a.m. CET	NOK	100	kilogram	do fixingu <sup>2</sup>	Ostatni dzień roboczy miesiąca następującego po ostatnim dniu obserwacji

- dotyczy transakcji opcji towarowej:

Grupa	Nazwa	Cena referencyjna Sposób ustalania i źródło ceny	Czas publikacji <sup>5</sup>	Waluta	Minimalny nominalny transakcji	Jednostka miary	Sposób zamknięcia	Data rozliczenia <sup>1</sup>
METALE BAZOWE	Cynk	ZINC CASH LME	12:55 GMT	USD	25	tona metryczna	do fixingu <sup>2</sup>	2. dzień roboczy towaru po wygaśnięciu opcji
	Ołów	LEAD-LME CASH	12:50 GMT					
ENERGIA	Dated Brent Platts	OIL-BRENT (DTD)-PLATTS MARKETWIRE	16:30 GMT	USD	1 000	baryłka	do fixingu <sup>2</sup>	5. dzień roboczy towaru po ostatnim dniu obserwacji
	Paliwo lotnicze Jet Cargoes CIF NWE	JET FUEL-CARGOES CIF NWE/BASIS ARA-PLATTS EUROPEAN (Platts code PJAAU00)		USD	100	tona metryczna		
	Węgiel TSI Coking Coal	Platts Settlement Price - TSI Premium Hard Coking Coal Australia Export FOB East Coast Port (Platts code TS01034)	10:30 GMT	USD	1 000	tona metryczna		

- dotyczy transakcji na rynku uprawnień do emisji gazów cieplarnianych rozliczanych kasowo do ceny średniej (swapy azjatyckie)

Grupa	Nazwa	Cena referencyjna Sposób ustalania i źródło ceny	Czas publikacji	Waluta	Minimalny nominalny transakcji	Jednostka miary	Sposób zamknięcia	Data rozliczenia*
GAZY CIEPLARNIANE	prawa do emisji CO <sub>2</sub>	ICE Monthly EUA Futures Contract, Settlement Price;	17:15 CET	EUR	1000	tona metryczna	do fixingu	5 dni roboczych po okresie obserwacji

<sup>1</sup> w przypadku, w którym dzień rozliczenia nie jest dniem roboczym w Polsce, dniem rozliczenia jest pierwszy przypadający po tym dniu dzień roboczy towaru, który jest jednocześnie dniem roboczym w Polsce,

<sup>2</sup> transakcja zostanie rozliczona do oficjalnego kursu towaru publikowanego przez podmiot podający cenę referencyjną (fixing) w dniu obserwacji (lub w dniach obserwacji, w przypadku swapów rozliczanych do średniej ceny z kilku dni obserwacji) określonym w transakcji. W przypadku transakcji rozliczanych do ceny z jednego dnia obserwacji, w dniu zawarcia transakcji strony mogą ustalić sposób zamknięcia przez transakcję zamykającą. W takim wypadku wymagane jest zawarcie przez Klienta transakcji przeciwstawnej do transakcji pierwotnej.

<sup>3</sup> z dnia roboczego poprzedzającego dany dzień obserwacji,

<sup>4</sup> HIGH oznacza możliwość rozliczenia towaru do ceny najwyższej High Platts,

<sup>5</sup> Czas publikacji jest jednocześnie godziną wygaśnięcia opcji towarowej. W przypadku opcji, dla których występuje kilka dat publikacji, czas ostatniej publikacji jest godziną wygaśnięcia opcji towarowej.

Postanowienia niniejszego Komunikatu mają zastosowanie od dnia 15 lutego 2024 r.