

KOMUNIKAT nr 37/DOP/2019
PREZESA ZARZĄDU CENTRALNEGO DOMU MAKLERSKIEGO PEKAO S.A.
z dnia 22 maja 2019 roku

w sprawie parametrów stosowanych do wyliczenia minimalnego, maksymalnego i wstępnego zabezpieczenia dla derywatów oraz ich wysokości

Treść komunikatu

1. Centralny Dom Maklerski Pekao S.A. (CDM) informuje, że:
 - 1) do wyliczeń minimalnego, maksymalnego i wstępnego zabezpieczenia dla derywatów na rachunkach inwestycyjnych w CDM stosuje się metodykę SPAN (*The Standard Portfolio Analysis of Risk*), wykorzystywaną przez izbę rozliczeniową KDPW_CCP S.A., w tym parametry ryzyka wykorzystywane w metodyce (algorytmie) SPAN, zamieszczoną przez KDPW_CCP S.A. na stronie www.kdpwccp.pl/pl/zarzadzanie/Strony/metodologiaSPAN.aspx, z zastrzeżeniem pkt 2,
 - 2) przy otwieraniu pozycji – do wyliczenia maksymalnej i wstępnej wysokości zabezpieczenia parametry i podejście wykorzystywane w metodyce SPAN ulegają następującej modyfikacji:

Lp	Parametr/dane	Wartość
1.	Współczynnik korekty poziomu zmienności PSR* dla derywatów na indeksy WIG20 i WIG40	1,10
2.	Współczynnik korekty poziomu zmienności PSR* dla derywatów na instrumenty bazowe inne niż indeksy	1,20
3.	Współczynnik uznania dodatniego salda zrealizowanych zysków i strat nierozliczonych kontraktów terminowych	0,00
4.	Współczynnik uznania ujemnego salda zrealizowanych zysków i strat nierozliczonych kontraktów terminowych	1,00
5.	Współczynnik uznania dodatniego salda niezrealizowanych zysków i strat dla otwartych pozycji na kontraktach terminowych**	0,00
6.	Współczynnik uznania ujemnego salda niezrealizowanych zysków i strat dla otwartych pozycji na kontraktach terminowych**	0,00
7.	Współczynnik uznania należności z nierozliczonej premii opcyjnej	1,00
8.	Współczynnik uznania zobowiązań z nierozliczonej premii opcyjnej	1,00
9.	Uwzględnianie spreadu międzyklasowego	TAK

* *Price Scan Range*

** Do wyliczenia niezrealizowanych zysków i strat dla otwartych pozycji przyjmuje się ostatni kurs rynkowy jako symulowany kurs rozliczeniowy

3) wysokość zabezpieczenia wynosi:

Lp	Nazwa instrumentu	Klasa instrumentu	Minimalna wysokość zabezpieczenia w % (PSR*)	Maksymalna wysokość zabezpieczenia w % (PSR* skorygowany o wsp. korekty)	Wysokość wstępnego zabezpieczenia w % (PSR* skorygowany o wsp. korekty)
1.	Futures na WIG20	W20	6,80 %	7,48 %	7,48 %
2.	Futures na WIG20 – <i>Intraday</i> **	W20	2,70 %	2,97 %	2,97 %
3.	Futures na mWIG40	W40	4,90 %	5,39 %	5,39 %
4.	Futures na EUR	EUR	2,10 %	2,52 %	2,52 %
5.	Futures na USD	USD	3,80 %	4,56 %	4,56 %
6.	Futures na CHF	CHF	3,30 %	3,96 %	3,96 %
7.	Futures na GBP	GBP	3,10 %	3,72 %	3,72 %
8.	Futures na 11 BIT STUDIOS S.A.	11B	20,60%	24,72 %	24,72 %
9.	Futures na ASSECO POLAND S.A.	ACP	7,50 %	9,00 %	9,00 %
10.	Futures na ALIOR S.A.	ALR	8,40 %	10,08 %	10,08 %
11.	Futures na GRUPA AZOTY S.A.	ATT	11,00 %	13,20 %	13,20 %
12.	Futures na BORYSZEW S.A.	BRS	13,60 %	16,32 %	16,32 %
13.	Futures na CCC S.A.	CCC	9,60 %	11,52 %	11,52 %
14.	Futures na CD PROJEKT RED S.A.	CDR	14,80 %	17,76 %	17,76 %
15.	Futures na CIECH S.A.	CIE	9,80 %	11,76 %	11,76 %
16.	Futures na CI Games S.A.	CIG	21,10 %	25,32 %	25,32%
17.	Futures na CYFROWY POLSAT S.A.	CPS	7,60 %	9,12 %	9,12 %
18.	Futures na DINO POLSKA S.A.	DNP	8,10 %	9,72 %	9,72 %
19.	Futures na ENEA S.A.	ENA	8,60 %	10,32 %	10,32 %
20.	Futures na ENERGA S.A.	ENG	8,40 %	10,08 %	10,08 %
21.	Futures na EUROCASH S.A.	EUH	10,30 %	12,36 %	12,36 %
22.	Futures na GPW S.A.	GPW	6,90 %	8,28 %	8,28 %
23.	Futures na ING BANK ŚLĄSKI S.A.	ING	8,10 %	9,72 %	9,72 %
24.	Futures na JSW S.A.	JSW	13,70 %	16,44 %	16,44 %
25.	Futures na KERNEL HOLDING S.A.	KER	10,50 %	12,60 %	12,60 %
26.	Futures na KGHM POLSKA MIEDŹ S.A.	KGH	9,80 %	11,76 %	11,76 %

27.	Futures na KRUK S.A.	KRU	9,00 %	10,80 %	10,80 %
28.	Futures na LPP S.A.	LPP	9,20 %	11,04 %	11,04 %
29.	Futures na GRUPA LOTOS S.A.	LTS	8,80 %	10,56 %	10,56 %
30.	Futures na LIVECHAT SOFTWARE S.A.	LVC	12,40 %	14,88 %	14,88 %
31.	Futures na LWB S.A.	LWB	9,60 %	11,52 %	11,52 %
32.	Futures na mBANK S.A.	MBK	9,50 %	11,40 %	11,40 %
33.	Futures na BANK MILLENNIUM S.A.	MIL	10,80 %	12,96 %	12,96 %
34.	Futures na ORANGE POLSKA S.A.	OPL	8,40 %	10,08 %	10,08 %
35.	Futures na BANK POLSKA KASA OPIEKI S.A.	PEO	7,90 %	9,48 %	9,48 %
36.	Futures na PGE S.A.	PGE	7,80 %	9,36 %	9,36 %
37.	Futures na PGNiG S.A.	PGN	7,70 %	9,24 %	9,24 %
38.	Futures na PKN ORLEN S.A.	PKN	8,20 %	9,84 %	9,84 %
39.	Futures na PKO BP S.A.	PKO	7,90 %	9,48 %	9,48 %
40.	Futures na PLAYWAY S.A.	PLW	18,30 %	21,96 %	21,96 %
41.	Futures na PLAY S.A.	PLY	9,30 %	11,16 %	11,16 %
42.	Futures na POLIMEX-MOSTOSTAL S.A.	PXM	22,40 %	26,88 %	26,88 %
43.	Futures na PZU S.A.	PZU	6,20 %	7,44 %	7,44 %
44.	Futures na SANTANDER BANK POLSKA S.A.	SPL	8,30 %	9,96 %	9,96 %
45.	Futures na TEN SQUARE GAMES S.A.	TEN	17,90 %	21,48 %	21,48 %
46.	Futures na TAURON POLSKA ENERGIA S.A.	TPE	8,20 %	9,84 %	9,84 %
47.	Futures na WIBOR 1M	1MW	0,30 %	0,36 %	0,36 %
48.	Futures na WIBOR 3M	3MW	0,46 %	0,55 %	0,55 %
49.	Futures na WIBOR 6M	6MW	0,44 %	0,53 %	0,53 %
50.	Futures na obligacje SP krótkoterminowe	STB	0,70 %	0,84 %	0,84 %
51.	Futures na obligacje SP średnioterminowe	MTB	1,20 %	1,44 %	1,44 %
52.	Futures na obligacje SP długoterminowe	LTB	2,10 %	2,52 %	2,52 %

* PSR – Price Scan Range

**dotyczy zleceń składanych w ramach portfela nr 99 (Intraday)

Centralny Dom Maklerski Pekao S.A.
Centrala

ul. Wołoska 18
02-675 Warszawa
tel. 22 821 88 22
fax 22 856 17 77

Centralny Dom Maklerski Pekao Spółka Akcyjna z siedzibą w Warszawie, ul. Wołoska 18, 02-675 Warszawa; dokumentacja w Sądzie Rejonowym dla m. st. Warszawy, XIII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego, nr KRS: 0000024477, NIP: 521-26-54-772; wysokość kapitału zakładowego, w pełni wpłaconego: 56 331 898 zł.

2. Traci moc *Komunikat nr 26/DOP/2019 Prezesa Zarządu Centralnego Domu Maklerskiego S.A. z dnia 17 kwietnia 2019 roku w sprawie parametrów stosowanych do wyliczenia minimalnego, maksymalnego i wstępnego zabezpieczenia dla derywatów oraz ich wysokości.*

Podstawa prawna

§ 74 Regulaminu świadczenia usług maklerskich przez Centralny Dom Maklerski Pekao S.A.

Data wejścia w życie: 22 maja 2019 r.

PREZES ZARZĄDU

/Piotr Teleon/