

## Komunikat z dnia 25-04-2022 r.

w sprawie określenia wysokości wstępnego i właściwego depozytu zabezpieczającego oraz terminu jego uzupełnienia

### § 1

Na podstawie § 64 ust. 8 i § 67 ust. 3 Regulaminu wykonywania zleceń i prowadzenia rachunków papierów wartościowych przez Biuro Maklerskie Alior Bank S.A. obowiązującego dla umów zawartych do 28 lutego 2022 r. oraz § 63 ust. 8 i § 66 ust. 3 Regulaminu wykonywania zleceń i prowadzenia rachunków papierów wartościowych przez Biuro Maklerskie Alior Bank S.A. obowiązującego dla umów zawartych od 1 marca 2022 r. ustala się wysokość wstępnego i właściwego depozytu zabezpieczającego.

### § 2

Do wyliczenia wstępnego i właściwego depozytu zabezpieczającego stosuje się metodykę SPAN używaną przez izbę rozliczeniową KDPW\_CCP S.A.

Opis metodyki oraz bieżące parametry ryzyka publikowane są na stronie internetowej KDPW\_CCP:

<http://www.kdpwccp.pl/pl/zarzadzanie/Strony/metodologiaSPAN.aspx>

### § 3

Wysokość wstępnego depozytu zabezpieczającego ustalona jest na poziomie 120% PSR wyznaczonego przez KDPW\_CCP.

Wysokość właściwego depozytu zabezpieczającego ustalona jest na poziomie 100% PSR wyznaczonego przez KDPW\_CCP.

### § 4

Dodatkowe zabezpieczenie pozycji Klienta wymagane przez KDPW\_CCP tj. depozyt zabezpieczający ryzyko korelacji wrong way risk WWR oraz depozyt zabezpieczający ryzyko płynności i koncentracji LCR pokrywane jest ze środków własnych Biura Maklerskiego.

### § 5

Na podstawie § 72 ust. 2 Regulaminu wykonywania zleceń i prowadzenia rachunków papierów wartościowych przez Biuro Maklerskie Alior Bank S.A. obowiązującego dla umów zawartych do 28 lutego 2022 r. oraz § 71 ust. 2 Regulaminu wykonywania zleceń i prowadzenia rachunków papierów wartościowych przez Biuro Maklerskie Alior Bank S.A. obowiązującego dla umów zawartych od 1 marca 2022 r. ustala się termin ostatecznego uzupełnienia depozytu zabezpieczającego na 15 minut przed rozpoczęciem notowań derywatów w dniu następującym po dniu, w którym depozyt spadł poniżej wartości określonej dla właściwego depozytu zabezpieczającego.

§ 6

1. Traci ważność komunikat w sprawie określenia wysokości wstępnego i właściwego depozytu zabezpieczającego oraz terminu jego uzupełnienia z dnia 1 lipca 2015 roku.
2. Komunikat wchodzi w życie z dniem **25 kwietnia 2022 roku.**

Jacek Janiuk

Dyrektor Biura Maklerskiego Alior Bank S.A.