

Standard kontraktów terminowych na kurs GBP/PLN i CHF/PLN

Standard kontraktów terminowych na kurs funta brytyjskiego i franka szwajcarskiego, określony Uchwałą Nr 325/2008 Zarządu Giełdy z dnia 30 kwietnia 2008 r. (z późn. zm.):

Nazwa skrócona kontraktu	FXYZkrr, Gdzie: F-rodzaj instrumentu XYZ - oznaczenie waluty, której kurs jest instrumentem bazowym (odpowiednio GBP (funt brytyjski) lub CHF (frank szwajcarski)) k-kod miesiąca wykonania (określony uchwałą Zarządu Giełdy) rr- dwie ostatnie cyfry roku wykonania
Kod kontraktu	Nadawany przez podmiot rozliczający zgodnie ze standardem ISIN
Instrument bazowy	Kurs GBP/PLN Kurs CHF/PLN
Jednostka transakcyjna (wielkość kontraktu)	1000 GBP 1000 CHF
Jednostka notowania	W złotych polskich (PLN) (za 1 GBP lub 1 CHF)
Miesiące wykonania	3 najbliższe miesiące kalendarzowe + 3 kolejne miesiące z marcowego cyklu kwartalnego (marzec, czerwiec, wrzesień, grudzień).
Ostatni dzień obrotu	Trzeci piątek miesiąca wykonania danej serii. Notowanie serii kontraktów wygasających w tym dniu kończy się o godzinie 10.30. Jeżeli jednak w dniu o którym mowa w zdaniu poprzedzającym, zgodnie z przepisami obowiązującymi na giełdzie nie odbywa się sesja giełdowa, wówczas ostatnim dniem obrotu jest ostatni dzień sesyjny przypadający przed trzecim piątkiem miesiąca wykonania. Giełda może określić inny ostatni dzień obrotu, podając informację o tym do publicznej wiadomości co najmniej na 4 tygodnie wcześniej. Określenie innego ostatniego dnia obrotu może nastąpić w szczególności w przypadku podjęcia przez Zarząd Giełdy decyzji o rezygnacji z dalszego notowania kontraktów terminowych danej klasy z uwagi na przesłanki uzasadniające w ocenie Zarządu Giełdy zakończenie obrotu danymi instrumentami czy też z uwagi na okoliczności niezależne od Giełdy a dotyczące statusu prawnego lub konstrukcji instrumentu bazowego. Decyzja ta może być podjęta również z uwagi na konieczność zapewnienia bezpieczeństwa obrotu giełdowego lub ochronę interesów inwestorów giełdowych.
Dzień wygaśnięcia	Dzień ustalenia ostatecznego kursu rozliczeniowego. Ten sam dzień, co ostatni dzień obrotu.
Pierwszy dzień obrotu nowej serii	Dzień sesyjny przypadający po dniu wygaśnięcia poprzedniej serii kontraktów. W przypadku pierwszego wprowadzenia serii kontraktów do obrotu określany przez Zarząd Giełdy.

Dzienny kurs rozliczeniowy	1. Dzienny kurs rozliczeniowy wyznaczany jest po każdej sesji począwszy od dnia, w którym zawarto pierwszą transakcję kontraktami danej serii z wyjątkiem dnia wygaśnięcia. Za dzienny kurs rozliczeniowy uznaje się kurs ostatniej transakcji kontraktami danej serii zawartej na sesji giełdowej, po której wyznacza się dzienny kurs rozliczeniowy a w przypadku braku transakcji na tej sesji za dzienny kurs rozliczeniowy przyjmuje się ostatni kurs rozliczeniowy. 2. Jeśli jednak w arkuszu zleceń na zakończenie fazy aukcji zamknięcia, w tym na zakończenie równoważenia dodatkowego, jeżeli ma ono miejsce, jest choć jedno zlecenie opiewające na co najmniej 50 kontraktów terminowych z limitem lepszym (kupna wyższym, sprzedaży niższym) od kursu rozliczeniowego określonego zgodnie z pkt 1, za dzienny kurs rozliczeniowy przyjmuje się limit najlepszego z tych zleceń. W przypadku zleceń kupna jest to najwyższy limit zlecenia kupna przekraczający kurs określony zgodnie z pkt 1. I odwrotnie, w przypadku zleceń sprzedaży jest to najniższy limit zlecenia sprzedaży poniżej kursu określonego zgodnie z pkt 1. Jeżeli limit w zleceniu, o którym mowa powyżej, wykracza poza górne albo dolne ograniczenie wahań kursów obowiązujące na zakończenie fazy aukcji zamknięcia, w tym na zakończenie równoważenia dodatkowego, jeżeli ma miejsce na zakończenie fazy aukcji zamknięcia, wówczas za dzienny kurs rozliczeniowy przyjmuje się odpowiednio górne albo dolne ograniczenie wahań kursów obowiązujące na zakończenie fazy aukcji zamknięcia, w tym na zakończenie równoważenia dodatkowego. 3. Jeżeli na zakończenie fazy aukcji zamknięcia ma miejsce równoważenie dodatkowe z określonym teoretycznym kursem otwarcia i notowania w tym dniu kończą się tym równoważeniem wówczas za dzienny kurs rozliczeniowy uznaje się ten teoretyczny kurs otwarcia, o ile teoretyczny wolumen otwarcia wynosi co najmniej 50 kontraktów terminowych. Jeżeli tak określony dzienny kurs rozliczeniowy wykracza poza górne albo dolne ograniczenie wahań kursów obowiązujące na zakończenie równoważenia dodatkowego, o którym mowa powyżej, wówczas za dzienny kurs rozliczeniowy przyjmuje się odpowiednio górne albo dolne ograniczenie wahań kursów obowiązujące na zakończenie tego równoważenia dodatkowego. 4. W uzasadnionych przypadkach, w celu zapewnienia bezpieczeństwa obrotu giełdowego, w szczególności w sytuacji, gdy z uwagi na zaistniałe okoliczności określenie dziennego kursu rozliczeniowego na warunkach wskazanych powyżej mogłoby zagrozić płynności rozliczeń kontraktów terminowych Giełda po konsultacji z KDPW_CCP może wyznaczyć dzienny kurs rozliczeniowy inny niż wyznaczony na warunkach określonych powyżej. Do okoliczności tych można
-----------------------------------	---

	zaliczyć m.in. awarię systemów informatycznych giełdy mogącą mieć wpływ na wiarygodność wyznaczenia dziennego kursu rozliczeniowego, a także każde inne zdarzenie, którego zaistnienie może, w ocenie Giełdy oraz KDPW_CCP, podważyć wiarygodność dziennego kursu rozliczeniowego wyznaczonego na warunkach wskazanych powyżej lub prawidłowość wyznaczenia tego kursu.
Ostateczny kurs rozliczeniowy	Kurs średni funta brytyjskiego lub franka szwajcarskiego ustalony przez NBP na fixingu w dniu wygaśnięcia kontraktu, określany z dokładnością do 0,0001 PLN (za 1 GBP lub 1 CHF).
Dzienna cena rozliczeniowa	Dzienny kurs rozliczeniowy pomnożony przez wielkość kontraktu.
Ostateczna cena rozliczeniowa	Ostateczny kurs rozliczeniowy pomnożony przez wielkość kontraktu.
Dzień rozliczenia	Następny dzień roboczy po dniu wygaśnięcia danej serii kontraktów
Opublikowanie dziennej i ostatecznej ceny rozliczeniowej	Bezzwłocznie po zakończeniu notowań.
Sposób rozliczenia	Pieniężne w złotych polskich.
Depozyt zabezpieczający wnoszony przez inwestora	Firma inwestycyjna lub bank powierniczy określa poziom depozytu zabezpieczającego wnoszonego przez inwestora.