

**SANTANDER BANK POLSKA  
SPÓŁKA AKCYJNA  
CZŁONEK ZARZĄDU BANKU**

**Zarządzenie Członka Zarządu Banku nr 716/2018  
z dnia 17 października 2018 r.**

**w sprawie: określenia warunków świadczenia usług obrotu derywatami na Portfelach Intraday**

---

Działając na podstawie § 1 ust. 1 Uchwały Zarządu Banku nr 4/2001 z dnia 14 czerwca 2001 r., w sprawie upoważnień dla członków Zarządu Banku z późn. zm., zarządzam co następuje:

§ 1

1. Santander Biuro Maklerskie (dalej: Biuro Maklerskie) wprowadza możliwość zawierania transakcji z obniżonym poziomem depozytu zabezpieczającego, dalej zwanych transakcjami Intraday. Transakcje intraday dedykowane są inwestycjom krótkoterminowym (jednodniowym).
2. Transakcje intraday dotyczą niżej wymienionych instrumentów:
  - a) seria kontraktów indeksowych opartych na indeksie WIG20 o najkrótszym czasie do wygaśnięcia,
  - b) seria kontraktów indeksowych opartych na indeksie WIG20 o drugim z kolei, najkrótszym czasie do wygaśnięcia.
3. Depozyty zabezpieczające dla transakcji intraday mogą być wnoszone w postaci środków pieniężnych w walucie danego derywatu oraz instrumentach finansowych. Wysokość depozytów zabezpieczających (standardowych oraz intraday) publikowana jest codziennie w serwisie internetowym Biura Maklerskiego.

§ 2

1. Zlecenia dotyczące transakcji intraday przyjmowane są na dedykowanym do tego typu transakcji portfelu, zwanym dalej Portfelem Intraday.
2. W tym celu Biuro Maklerskie wprowadza dwa oznaczenia dla portfeli:
  - a) Portfel Standard: portfel, na którym można zapisywać i rozliczać wszystkie derywaty dostępne w ofercie Biura Maklerskiego, depozyty zabezpieczające wymagane są w wysokości standardowej,
  - b) Portfel Intraday: portfel, na którym można zapisywać i rozliczać wyłącznie derywaty dostępne dla transakcji intraday, depozyty zabezpieczające wymagane są w wysokości obniżonej, z zastrzeżeniem §3 ust. 4 i 5.
3. Klient ma możliwość zmiany oznaczenia swojego portfela w każdym momencie, pod warunkiem braku pozycji zapisanych na tym portfelu oraz braku aktywnych, oczekujących na realizację zleceń na tym portfelu.
4. Klient może posiadać tylko jeden Portfel Intraday. Portfel Intraday może być jedynym posiadanym przez klienta portfelem.
5. W przypadku posiadania większej niż jeden liczby portfeli klient może oznaczyć jako Portfel Intraday dowolny z posiadanych przez siebie portfeli, pod warunkiem braku pozycji zapisanych na tym portfelu oraz braku aktywnych, oczekujących na realizację zleceń na tym portfelu.

§ 3

1. Biuro Maklerskie przyjmuje zlecenia dotyczące transakcji Intraday do godziny 16:30 w dniu bieżącej sesji. W uzasadnionych przypadkach Biuro Maklerskie może zmienić godzinę, do której przyjmowane są zlecenia. Godzina publikowana jest codziennie w serwisie internetowym Biura Maklerskiego. W przypadku zmiany godziny przepisy niniejszego zarządzenia związane z ww. godziną stosuje się odpowiednio.
2. Zlecenia otwierające, złożone na Portfelu Intraday i wykonywane po godz. 16:30 wykonywane są pod warunkiem posiadania przez klienta depozytu zabezpieczającego w wysokości standardowej.
3. Klient może utrzymać pozycje otwarte w transakcjach intraday dłużej niż przez jedną sesję pod warunkiem posiadania środków finansowych na otwarte pozycje wymaganych dla pozycji z depozytem zabezpieczającym w wysokości standardowej.
4. Dla pozycji skorelowanych na Portfelu Intraday wymagany jest depozyt zabezpieczający w wysokości standardowej.
5. Biuro Maklerskie przeprowadza kontrolę pokrycia na Portfelach Intraday klientów w następujący sposób:

- a) o godzinie 16:30 sprawdzany jest wymagany depozyt zabezpieczający dla salda portfeli oraz potencjalnego salda portfeli wynikającego z oczekujących, nie zrealizowanych zleceń otwierających pozycje. Jeśli klient posiada pokrycie dla tak obliczonego depozytu zabezpieczającego, wykonywane jest odpowiednie księgowanie środków finansowych z rachunku podstawowego na rachunek zabezpieczeń. W przeciwnym wypadku, Biuro Maklerskie odwołuje wszystkie zlecenia otwierające pozycje i informuje klienta w sposób przewidziany w dyspozycji świadczenia usług w zakresie derywatów oraz w serwisie transakcyjnym o wysokości brakującej kwoty i ilości pozycji do zamknięcia.
  - b) o godzinie 16:50 ponownie sprawdzany jest wymagany depozyt zabezpieczający dla salda portfeli oraz potencjalnego salda portfeli wynikającego z oczekujących, nie zrealizowanych zleceń otwierających pozycje. W przypadku dopłaty środków przez klienta depozyt zabezpieczający jest uzupełniany. W sytuacji braku pokrycia Biuro Maklerskie odwołuje wszystkie zlecenia klienta (w tym zamykające) na Portfelu Intraday i wystawia zlecenia zamykające pozycje na tym portfelu odpowiednio do posiadanego przez klienta pokrycia. Na Portfelu Intraday mogą zostać tylko te pozycje, które są pokryte depozytem zabezpieczającym w wysokości standardowej. Biuro Maklerskie wystawia zlecenia zamykające bez limitu ceny (PKC). Klient nie może odwołać ani modyfikować zleceń wystawionych przez Biuro Maklerskie.
  - c) Prowizja brokerska od realizacji zleceń zamykających wystawianych przez Biuro Maklerskie pobierana jest zgodnie z Taryfą opłat i prowizji Santander Biuro Maklerskie.
6. Kolejnego dnia sesyjnego dla wszystkich nowych pozycji klienta otwieranych na Portfelu Intraday blokowany jest depozyt zabezpieczający w wysokości dla transakcji Intraday. Dla pozycji przechodzącej z poprzedniego dnia blokowany jest depozyt zabezpieczający w wysokości standardowej, aż do momentu zamknięcia danej pozycji. Przed zakończeniem sesji procedura weryfikacji pokrycia niezamkniętych przez klienta pozycji, o której mowa w §3 powtarza się.
  7. Biuro Maklerskie przyjmuje zlecenia na Portfelu Intraday z wszystkimi dopuszczonymi przez Giełdę Papierów Wartościowych oznaczeniami ceny oraz z wybranymi oznaczeniami ważności tj: ważne na sesję, ważne do określonej godziny, ważne na zamknięcie, ważne na fixing, wykonaj i anuluj, wykonaj lub anuluj. Biuro Maklerskie zwraca uwagę klientom na zwiększone ryzyko związane z inwestycjami w derywaty z depozytem Intraday wynikające ze zwiększonej dźwigni finansowej.

#### § 4

Traci moc Zarządzenie Członka Zarządu Banku nr 252/2015 z dnia 24 kwietnia 2015 r. w sprawie: określenia warunków świadczenia usług obrotu derywatami na Portfelach Intraday.

#### § 5

Zarządzenie wchodzi w życie z dniem podpisania.

Wiceprezes Zarządu Banku

Arkadiusz Przybył