

Uchwała Nr 384/10

Zarządu Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.

z dnia 29 czerwca 2010 r.

o zmianie uchwały nr 201/09 z dnia 2 czerwca 2009 r. w sprawie zasad wyznaczania minimalnej wartości środków pobieranych przez uczestników od osób zlecających zawarcie transakcji na rynku instrumentów pochodnych

§ 1

Na podstawie § 2 ust. 1 i 3 w zw. z § 68 ust. 1 Regulaminu Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych, Zarząd Krajowego Depozytu postanawia dokonać następujących zmian w załączniku do uchwały nr 201/09 z dnia 2 czerwca 2009 r. w sprawie zasad wyznaczania minimalnej wartości środków pobieranych przez uczestników od osób zlecających zawarcie transakcji na rynku instrumentów pochodnych:

a/ w pkt 3 „Zasady korelacji” w sekcji „D. Model wyceny opcji – obliczenia wartości ryzyka dla opcji” definicja zmiennej q otrzymuje brzmienie:

„ q – ustalona przez GPW wartość rocznej stopy dywidendy instrumentu bazowego dla danej serii opcji, a w przypadku opcji na kursy walut – stopa wolna od ryzyka waluty bazowej określona dla danej serii opcji,”;

b/ w pkt 3 „Zasady korelacji” w sekcji „D. Model wyceny opcji – obliczenia wartości ryzyka dla opcji” definicja zmiennej r otrzymuje brzmienie:

„ r – stopa wolna od ryzyka waluty notowań określona dla danej serii opcji,”.

§ 2

Uchwała wchodzi w życie z dniem 13 lipca 2010 r.

dr Iwona Sroka
Prezes Zarządu