

## Zarządzenie nr 7 Dyrektora Domu Maklerskiego BOŚ S.A. z dnia 28 czerwca 2019 roku

1. Działając zgodnie z postanowieniami § 1 ust. 2 pkt 33a) „Regulaminu świadczenia usług wykonywania zleceń przez Dom Maklerski Banku Ochrony Środowiska S.A. w obrocie Instrumentami Finansowymi oraz prowadzenia rachunków i rejestrów związanych z tym obrotem – rynek OTC” dalej „Regulamin” ustala się następujący mechanizm naliczania punktów swapowych:

- 1) wzory na obliczenie punktów swapowych dla walut:

$$Y_{r_{bid}} = Y_r - \text{marża}_{Y_{r_{bid}}}$$

$$Y_{r_{ask}} = Y_r + \text{marża}_{Y_{r_{ask}}}$$

$$X_{r_{bid}} = X_r - \text{marża}_{X_{r_{bid}}}$$

$$X_{r_{ask}} = X_r + \text{marża}_{X_{r_{ask}}}$$

$$Y_{time} = \frac{7}{\text{konwencja wyznaczania roku}}$$

$$X_{time} = \frac{7}{\text{konwencja wyznaczania roku}}$$

$$FV_{ask} = XY_{ask} \cdot \frac{1 + Y_{r_{bid}} \cdot Y_{time}}{1 + X_{r_{ask}} \cdot X_{time}}$$

$$FV_{bid} = XY_{bid} \cdot \frac{1 + Y_{r_{ask}} \cdot Y_{time}}{1 + X_{r_{bid}} \cdot X_{time}}$$

$$\text{long swap} = \frac{-(FV_{bid} - XY_{bid})}{7} \cdot \text{multiple}$$

$$\text{short swap} = \frac{(FV_{ask} - XY_{ask})}{7} \cdot \text{multiple}$$

Gdzie:

X- symbol waluty bazowej,

Y – symbole waluty kwotowanej,

$XY_{ask}$ ,  $XY_{bid}$  – wartości ask i bid dla danej pary walutowej,

$Y_r$ ,  $X_r$  – stopy procentowe dla danej waluty,

$X_{r_{ask}}$ ,  $X_{r_{bid}}$  – ask, bid stopy procentowej dla waluty bazowej,

$Y_{r_{bid}}$ ,  $Y_{r_{ask}}$  – ask i bid stopy procentowej dla waluty kwotowanej,

$X_{time}$  – horyzont czasowy w latach,

$\text{marża}_{Y_{r_{bid}}}$  - marża bid dla waluty kwotowanej,

$\text{marża}_{Y_{r_{ask}}}$  - marża ask dla waluty kwotowanej,

$\text{marża}_{X_{r_{bid}}}$  - marża bid dla waluty bazowej,

$\text{marża}_{X_{r_{ask}}}$  - marża ask dla waluty bazowej

$\text{multiple} = 1 / \text{wielkość jednego pipsa wg tabeli specyfikacji instrumentów}$

- 2) wzory na obliczenie punktów swapowych dla towarów (SILVER., PLATINUM., PALLADIUM.):

$$X_{r_{bid}} = X_r - marża_{X_{r_{bid}}}$$

$$X_{r_{ask}} = X_r + marża_{X_{r_{ask}}}$$

$$FV_{ask} = Z_{ask} \cdot (1 + X_{r_{bid}} \cdot X_{time})$$

$$FV_{bid} = Z_{bid} \cdot (1 + X_{r_{ask}} \cdot X_{time})$$

$$long\ swap = \frac{-(FV_{bid} - Z_{bid})}{7} \cdot multiple$$

$$short\ swap = \frac{(FV_{ask} - Z_{ask})}{7} \cdot multiple$$

Gdzie:

$X_r$  – stopa procentowa dla danej waluty,

$Z_{bid}, Z_{ask}$  – wartość bid, ask dla danego towaru,

$X_{r_{bid}}, X_{r_{ask}}$  - bid, ask stopy procentowe dla waluty kwotowania towaru,

$X_{time}$  – horyzont czasowy w latach,

$marża_{X_{r_{bid}}}$  - marża bid dla waluty bazowej,

$marża_{X_{r_{ask}}}$  - marża ask dla waluty bazowej,

$multiple = 1 / \text{wielkość jednego pipsa wg tabeli specyfikacji instrumentów}$

2. Działając zgodnie z postanowieniami § 1 ust. 2 pkt 33a) oraz § 47 ust. 7 Regulaminu oraz postanowieniami pkt 1 niniejszego Zarządzenia określającego wzory na obliczanie punktów swapowych dla walut i towarów, ustala się rynkowe stopy oprocentowania depozytów i kredytów na rynku międzybankowym, wysokości marż doliczanych do stóp procentowych depozytów i kredytów na rynku międzybankowym, czas naliczenia punktów swapowych, a także dzień w którym naliczane są potrójne punkty swapowe zgodnie z tabelą, która stanowi załącznik nr 1 do niniejszego Zarządzenia.
3. Działając zgodnie z postanowieniami § 47 ust. 7 Regulaminu, Dom Maklerski BOŚ S.A. ustala konwencje zliczenia dni dla poszczególnych rynkowych stóp oprocentowania depozytów i kredytów na rynku międzybankowych zgodnie z tabelą, która stanowi załącznik nr 2 do niniejszego Zarządzenia
4. Traci moc Zarządzenie nr 1 Dyrektora Domu Maklerskiego BOŚ S.A. z dnia 20 lipca 2018 roku oraz Zarządzenie nr 1 Dyrektora Domu Maklerskiego BOŚ S.A. z dnia 15 czerwca 2018 roku.

Zarządzenie wchodzi w życie z dniem 07 lipca 2019 roku.

**Załącznik 1 do Zarządzenia nr 7 Dyrektora Domu Maklerskiego BOŚ S.A. z dnia 28 czerwca 2019 roku**

Nazwa instrumentu	Symbol waluty bazowej	Symbol waluty kwotowanej	Nazwa stopy procentowej dla waluty kwotowanej	Nazwa stopy procentowej dla waluty bazowej	Marża BID dla waluty kwotowanej w p.p.	Marża ASK dla waluty kwotowanej w p.p.	Marża BID dla waluty bazowej w p.p.	Marża ASK dla waluty bazowej w p.p.	Dzień naliczenia potrójnych punktów swapowych	Godzina naliczenia punktów swapowych
USDPLN	USD	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURPLN	EUR	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPPLN	GBP	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CHFPLN	CHF	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR CHF 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
JPYPLN	JPY	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR JPY 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURUSD	EUR	USD	ICE LIBOR USD 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPUSD	GBP	USD	ICE LIBOR USD 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDJPY	USD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDCHF	USD	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURGBP	EUR	GBP	ICE LIBOR GBP 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURJPY	EUR	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURCHF	EUR	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDCAD	USD	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPJPY	GBP	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDUSD	AUD	USD	ICE LIBOR USD 1W	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDJPY	AUD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDCAD	AUD	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDCHF	AUD	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDNZD	AUD	NZD	NZD BANK BILL 1M	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
NZDUSD	NZD	USD	ICE LIBOR USD 1W	NZD BANK BILL 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
NZDJPY	NZD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	NZD BANK BILL 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURCAD	EUR	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURAUD	EUR	AUD	AUD Bank Bill 1M	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURNZD	EUR	NZD	NZD BANK BILL 1M	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURNOK	EUR	NOK	Norwegian Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURSEK	EUR	SEK	Stockholm Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURDKK	EUR	DKK	Copenhagen Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURCZK	EUR	CZK	Czech Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00

EURHUF	EUR	HUF	Budapest Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURRON	EUR	RON	Romanian Interbank Offer Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURRUB	EUR	RUB	Moscow Prime Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURTRY	EUR	TRY	Bank Association of Turkey Rates 1W	ICE LIBOR EUR 1W	2,5	2,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDHKD	USD	HKD	Hong Kong Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDNOK	USD	NOK	Norwegian Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDSEK	USD	SEK	Stockholm Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDDKK	USD	DKK	Copenhagen Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDCZK	USD	CZK	Czech Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDHUF	USD	HUF	Budapest Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD RON	USD	RON	Romanian Interbank Offer Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD RUB	USD	RUB	Moscow Prime Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD ZAR	USD	ZAR	Johannesburg Interbank Agreed Rate 1M	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD MXN	USD	MXN	Mexico Interbank TIEE 28 Day	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD TRY	USD	TRY	Bank Association of Turkey Rates 1W	ICE LIBOR USD 1W	2,5	2,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD CNH	USD	CNH	Hong Kong Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD THB	USD	THB	Bank of Thailand BIBOR fixing 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USD BRL	USD	BRL	Brasil's Interbank Offered Rate 1M	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBP CHF	GBP	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBP AUD	GBP	AUD	AUD Bank Bill 1M	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBP NZD	GBP	NZD	NZD BANK BILL 1M	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBP CAD	GBP	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBP CZK	GBP	CZK	Czech Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CAD JPY	CAD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	Canada Bankers Acceptances 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CAD CHF	CAD	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	Canada Bankers Acceptances 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CHF JPY	CHF	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR CHF 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
SILVER	USD	-	-	ICE LIBOR USD 1W	1,0	1,0	1,0	1,0	piątek	23:59 - 0:00
PLATINUM	USD	-	-	ICE LIBOR USD 1W	1,0	1,0	1,0	1,0	piątek	23:59 - 0:00
PALLADIUM	USD	-	-	ICE LIBOR USD 1W	1,0	1,0	1,0	1,0	piątek	23:59 - 0:00
USD PLN.	USD	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EUR PLN.	EUR	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBP PLN.	GBP	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CHF PLN.	CHF	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR CHF 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00

JPYPLN..	JPY	PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR JPY 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURUSD.	EUR	USD	ICE LIBOR USD 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPUSD.	GBP	USD	ICE LIBOR USD 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDJPY.	USD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDCHF.	USD	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURGBP.	EUR	GBP	ICE LIBOR GBP 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURJPY.	EUR	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURCHF.	EUR	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDCAD.	USD	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPJPY.	GBP	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDUSD.	AUD	USD	ICE LIBOR USD 1W	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDJPY.	AUD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDCAD.	AUD	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDCHF.	AUD	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
AUDNZD.	AUD	NZD	NZD BANK BILL 1M	AUD Bank Bill 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
NZDUSD.	NZD	USD	ICE LIBOR USD 1W	NZD BANK BILL 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
NZDJPY.	NZD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	NZD BANK BILL 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURCAD.	EUR	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURAUD.	EUR	AUD	AUD Bank Bill 1M	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURNZD.	EUR	NZD	NZD BANK BILL 1M	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURNOK.	EUR	NOK	Norwegian Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURSEK.	EUR	SEK	Stockholm Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURDKK.	EUR	DKK	Copenhagen Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURCZK.	EUR	CZK	Czech Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURHUF.	EUR	HUF	Budapest Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURRON.	EUR	RON	Romanian Interbank Offer Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURRUB.	EUR	RUB	Moscow Prime Offered Rate 1W	ICE LIBOR EUR 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
EURTRY.	EUR	TRY	Bank Association of Turkey Rates 1W	ICE LIBOR EUR 1W	2,5	2,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDHKD.	USD	HKD	Hong Kong Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDNOK.	USD	NOK	Norwegian Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDSEK.	USD	SEK	Stockholm Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDDKK.	USD	DKK	Copenhagen Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDCZK.	USD	CZK	Czech Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDHUF.	USD	HUF	Budapest Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00

USDRON.	USD	RON	Romanian Interbank Offer Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDRUB.	USD	RUB	Moscow Prime Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDZAR.	USD	ZAR	Johanesburg Interbank Agreed Rate 1M	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDMXN.	USD	MXN	Mexico Interbank TIEE 28 Day	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDTRY.	USD	TRY	Bank Association of Turkey Rates 1W	ICE LIBOR USD 1W	2,5	2,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDCNH.	USD	CNH	Hong Kong Interbank Offered Rate 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDTHB.	USD	THB	Bank of Thailand BIBOR fixing 1W	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
USDBRL.	USD	BRL	Brasil's Interbank Offered Rate 1M	ICE LIBOR USD 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPCHF.	GBP	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPAUD.	GBP	AUD	AUD Bank Bill 1M	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPNZD.	GBP	NZD	NZD BANK BILL 1M	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPCAD.	GBP	CAD	Canada Bankers Acceptances 1M	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
GBPCZK.	GBP	CZK	Czech Interbank Offered Rates 1W	ICE LIBOR GBP 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CADJPY.	CAD	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	Canada Bankers Acceptances 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CADCHF.	CAD	CHF	ICE LIBOR CHF 1W	Canada Bankers Acceptances 1M	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
CHFJPY.	CHF	JPY	ICE LIBOR JPY 1W	ICE LIBOR CHF 1W	0,5	0,5	0,5	0,5	piątek	23:59 - 0:00
SILVER.	USD	-	-	ICE LIBOR USD 1W	1,0	1,0	1,0	1,0	piątek	23:59 - 0:00
PLATINUM.	USD	-	-	ICE LIBOR USD 1W	1,0	1,0	1,0	1,0	piątek	23:59 - 0:00
PALLADIUM.	USD	-	-	ICE LIBOR USD 1W	1,0	1,0	1,0	1,0	piątek	23:59 - 0:00

**Załącznik 2 do Zarządzenia nr 7 Dyrektora Domu Maklerskiego BOŚ S.A. z dnia 28 czerwca 2019 roku**

Waluta	Nazwa stopy procentowej	Konwencja liczenia dni
PLN	Warsaw Interbank Offered Rate 1W (WIBOR)	365
USD	ICE LIBOR USD 1W	360
EUR	ICE LIBOR EUR 1W	360
CHF	ICE LIBOR CHF 1W	360
GBP	ICE LIBOR GBP 1W	365
JPY	ICE LIBOR JPY 1W	360
AUD	AUD Bank Bill 1M	365
CAD	Canada Bankers Acceptances 1M (CDOR)	365
NZD	NZD BANK BILL 1M	365
CZK	Czech Interbank Offered Rates 1W (PRIBOR)	360
HUF	Budapest Interbank Offered Rates 1W (BUBOR)	360
RON	Romanian Interbank Offer Rate 1W (ROBOR)	360
TRY	Bank Association of Turkey Rates 1W (TRLIBOR)	360
RUB	Moscow Prime Offered Rate 1W	365
SEK	Stockholm Interbank Offered Rate 1W	360
NOK	Norwegian Interbank Offered Rate 1W (NIBOR)	360
MXN	Mexico Interbank TIIE 28 Day	360
ZAR	Johannesburg Interbank Agreed Rate 1M (JIBAR)	360
HKD	Hong Kong Interbank Offered Rate 1W (HIBOR)	365
DKK	Copenhagen Interbank Offered Rates 1W (CIBOR)	360
CNH	Hong Kong Interbank Offered Rate 1W (HICNH)	360
THB	Bank of Thailand BIBOR fixing 1W (BOWX1W)	365
BRL	Brasil's Interbank Offered Rate 1M	365