



SPECYFIKACJA INSTRUMENTÓW FINANSOWYCH DLA SYSTEMU IDM MINITRADER

I. Transakcje walutowe

➤ Warunki transakcyjne dla kontraktów walutowych SPOT oraz złota i srebra

Kurs krzyżowy	Wymagany depozyt zabezpieczający S	Wymagany depozyt zabezpieczający S5	Wymagany depozyt zabezpieczający S10	Maks. nominal automatycznego kwotowania	Min. rozmiar transakcji	Nominał transakcji	Spread
AUDJPY	1,0 %	5%	10%	AUD 3 500 000 / 3 500 000	AUD 1 000	Jakikolwiek	0,06
AUDUSD	1,0 %	5%	10%	AUD 7 000 000 / 7 000 000	AUD 1 000	Jakikolwiek	0,00030
CHFPLN	1,0 %	5%	10%	CHF 200 000 / 200 000	CHF 5 000	Jakikolwiek	0,0040
EURCHF	1,0 %	5%	10%	EUR 7 500 000 / 7 500 000	EUR 1 000	Jakikolwiek	0,00030
EURGBP	1,0 %	5%	10%	EUR 3 750 000 / 3 750 000	EUR 1 000	Jakikolwiek	0,00030
EURHUF	1,0 %	5%	10%	EUR 750 000 / 750 000	EUR 5 000	Jakikolwiek	0,30
EURJPY	1,0 %	5%	10%	EUR 7 500 000 / 7 500 000	EUR 1 000	Jakikolwiek	0,035
EURNOK	1,0 %	5%	10%	EUR 2 500 000 / 2 500 000	EUR 1 000	Jakikolwiek	0,0030
EURPLN	1,0 %	5%	10%	EUR 750 000 / 750 000	EUR 5 000	Jakikolwiek	0,0035
EURSEK	1,0 %	5%	10%	EUR 4 000 000 / 4 000 000	EUR 1 000	Jakikolwiek	0,0030
EURUSD	1,0 %	5%	10%	EUR 5 250 000 / 5 250 000	EUR 1 000	Jakikolwiek	0,00020
GBPCHF	1,0 %	5%	10%	GBP 1 250 000 / 1 250 000	GBP 1 000	Jakikolwiek	0,00070
GBPJPY	1,0 %	5%	10%	GBP 1 250 000 / 1 250 000	GBP 1 000	Jakikolwiek	0,070
GBPPLN	1,0 %	5%	10%	GBP 250 000 / 250 000	GBP 5 000	Jakikolwiek	0,0060
GBPUSD	1,0 %	5%	10%	GBP 2 500 000 / 2 500 000	GBP 1 000	Jakikolwiek	0,00040
NZDJPY	1,0 %	5%	10%	NZD 3 500 000 / 3 500 000	NZD 1 000	Jakikolwiek	0,07
NZDUSD	1,0 %	5%	10%	NZD 3 000 000 / 3 000 000	NZD 1 000	Jakikolwiek	0,00050
USDCAD	1,0 %	5%	10%	USD 4 200 000 / 4 200 000	USD 5 000	Jakikolwiek	0,00050
USDCHF	1,0 %	5%	10%	USD 5 000 000 / 5 000 000	USD 1 000	Jakikolwiek	0,00040
USDHKD	1,0 %	5%	10%	USD 5 000 000 / 5 000 000	USD 1 000	Jakikolwiek	0,0005

USDJPY	1,0 %	5%	10%	USD 5 000 000/ 5 000 000	USD 1 000	Jakikolwiek	0,030
USDPLN	1,0 %	5%	10%	USD 1 200 000/ 1 200 000	USD 5 000	Jakikolwiek	0,0035
USDSGD	1,0 %	5%	10%	USD 5 000 000/ 5 000 000	USD 1 000	Jakikolwiek	0,0006
XAGEUR	1,0 %	5%	10%	XAG 18 750 / 18 750	XAG 100	Jakikolwiek	0,04
XAGHKD	1,0 %	5%	10%	XAG 18 750 / 18 750	XAG 100	Jakikolwiek	0,3000
XAGJPY	1,0 %	5%	10%	XAG 18 750 / 18 750	XAG 100	Jakikolwiek	6,00
XAGUSD	1,0 %	5%	10%	XAG 25 000 / 25 000	XAG 100	Jakikolwiek	0,0550
XAUEUR	1,0 %	5%	10%	XAU 500 / 500	XAU 10	Jakikolwiek	0,65
XAUHKD	1,0 %	5%	10%	XAU 500 / 500	XAU 10	Jakikolwiek	7,00
XAUJPY	1,0 %	5%	10%	XAU 500 / 500	XAU 10	Jakikolwiek	100
XAUUSD	1,0 %	5%	10%	XAU 1 000 / 1 000	XAU 10	Jakikolwiek	0,60

II. Kontrakty CFD

➤ Warunki transakcyjne dla CFD na indeksy

Depozyty na CFD na indeksy są stałe i wynoszą 2% wartości nominalnej kontraktu.

Symbol	Nominał transakcji	Cena	Spread
AEX.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (1 punkt)
ASXSP200.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (4 punkty)
DAX.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (3 punkty)
MDAX.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (15 punktów)
FTSE100.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (3 punkty)
SPMIB.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (40 punkty)
NAS100.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (1 punkt)
SP500.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (1 punkt)
DJII	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (7 punktów)
CAC40.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (5 punktów)
STOXX50E.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (5 punktów)
SWE30.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (1 punkt)
SMLI	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (7 punktów)
NI225.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (30 punktów)
IBEX35.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (10 punktów)
BELG20.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (7 punktów)
FTSE250.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (20 punktów)
NOR25.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (2 punkty)
TECDAX.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (3 punkty)
DEN.I	Jakikolwiek	Jakikolwiek	Spread dla indeksów (2,5 punkta)

➤ Warunki transakcyjne dla CFD na towary

Symbol	Wymagany depozyt zabezpieczający	Min. rozmiar transakcji	Spread
OILUS	5%	25 baryłek	Spread rynkowy dla kontraktów futures (CL) + 0,06
OILUK	5%	25 baryłek	Spread rynkowy dla kontraktów futures (LCO) + 0,06
GASOLINEUS	5%	1 000 baryłek	Spread rynkowy dla kontraktów futures (RB) + 0,3
HEATINGOIL	5%	1 000 baryłek	Spread rynkowy dla kontraktów futures (HO) + 0,4
GOLD	5%	5 uncji	Spread rynkowy dla kontraktów futures (GC) + 0,8
SILVER	5%	200 uncji	Spread rynkowy dla kontraktów futures (SI) + 4,0
NATGASUS	5%	500 mmBtu (jednostek termicznych)	Spread rynkowy dla kontraktów futures (NG) + 0,018
COPPERUS	5%	1000 funtów	Spread rynkowy dla kontraktów futures (HG) + 0,6
COCOANY	5%	1 tona metryczna	Spread rynkowy dla kontraktów futures (CC) + 10
COFFEENY	5%	2000 funtów	Spread rynkowy dla kontraktów futures (KC) + 0,5
SUGARNY	5%	5000 funtów	Spread rynkowy dla kontraktów futures (SB) + 0,06
CORN	5%	200 buszli	Spread rynkowy dla kontraktów futures (ZC) + 1,5
SOYBEANS	5%	200 buszli	Spread rynkowy dla kontraktów futures (ZS) + 2
WHEAT	5%	200 buszli	Spread rynkowy dla kontraktów futures (ZW) + 2

Poniżej znajdują Państwo godziny handlu CFD poszczególne towary:

CFD na towary:	Godziny handlu (CET)			
	Pierwsza sesja		Druga sesja	
OILUS	00:00	23:15		
OILUK	02:00	00:00		
GASOLINEUS	00:00	23:15		
HEATINOILUS	00:00	23:15		
NATGASUS	00:00	23:15		
COPPERUS	00:00	23:15		
GOLD	00:00	23:15		
SILVER	00:00	23:15		
CORN	01:00	14:15	16:30	20:15
WHEAT	01:00	14:15	16:30	20:15
SOYBEANS	01:00	14:15	16:30	20:15
COFFEENY	09:30	20:00		
COCOANY	10:00	20:00		
SUGARNY	09:30	20:00		

W obrocie dostępne są zawsze dwa kontrakty CFD na towary odpowiadające bieżącej i kolejnej serii kontraktów futures, z tym że nazwa jest inna. Na przykład lipcowy kontrakt futures na ropę Light Sweet wygasający w 2009 roku ma symbol CLN9, podczas gdy lipcowy kontrakt różnic kursowych na ten sam instrument bazowy będzie miał symbol OILUSJUL09. Odpowiednio takie nazewnictwo będzie stosowało się do innych i kolejnych kontraktów. W ten sposób Klient będzie

miał możliwość manualnego rolowania kontraktu, gdyż CFD na towary będą wygasały każdego miesiąca. CFD na towary nie są rolowane automatycznie i wygasają w dacie zapadalności danej serii kontraktu futures o godzinie 17:00 CET. Jeśli Klient do tego czasu nie zamknie swojej pozycji, to system zrobi to automatycznie.

Rozliczenie kontraktu odbywa się gotówkowo na podstawie ceny zamknięcia ustalonej przez Partnera Zagranicznego dostarczającego kwotowań. CFD na towary są instrumentem handlowanym na rynku OTC, odzwierciedlającym wartość aktywa bazowego, dlatego aktualne ceny bid i offer mogą różnić się od cen kupna i sprzedaży aktualnego kontraktu futures. Cena rozliczenia będzie bazowała na cenie aktualnego kontraktu futures z godziny 17:00 CET, choć może się nieznacznie różnić, z tego względu, iż CFD na towary nie są handlowane na rynku regulowanym.

Wszystkie koszty związane z CFD na towary zawarte są w spreadzie. Nie ma dodatkowych kosztów finansowania.

W przypadku CFD na towary obowiązuje minimalny rozmiar transakcji umożliwiający otwarcie pozycji. W przypadku gdy Klient będzie pozostanie z pozycją poniżej minimalnego rozmiaru transakcji, będzie możliwość zamknięcia takiej pozycji za pośrednictwem Działu Rynków Zagranicznych.

OBJAŚNIENIA

Wymagany depozyt zabezpieczający to wielkość kapitału wymagana do zajęcia pozycji przypadku transakcji z użyciem dźwigni, stanowiąca zabezpieczenie globalnej pozycji wystawionej na ryzyko. Dom Maklerski IDM S.A. udostępnia jedną standardową grupę depozytową.

Obowiązują stawki depozytów określone jako Wymagany Depozyt Zabezpieczający w Specyfikacji Instrumentów Finansowych dla właściwego systemu transakcyjnego Depozyt wyliczany jest według stawki liniowej bez względu na nominal transakcji.

Automatyczne kwotowanie polega na podawaniu cen instrumentów w Systemie Transakcyjnym w sposób ciągły i umożliwia natychmiastową realizację zleceń po tych cenach. Maksymalny nominal automatycznego kwotowania podany w Specyfikacji określa kwotę przy której funkcja automatycznego kwotowania jest aktywna. W przypadku, kiedy funkcja automatycznego kwotowania jest nieaktywna, realizacja transakcji następuje w formie zapytania o cenę.

Minimalny rozmiar transakcji określa próg nominalu transakcji, poniżej którego nie jest możliwe zawieranie transakcji spot. Wszystkie transakcje o nominale nie niższym od progu wskazanego w Specyfikacji realizowane są bez opłat.

Nominal transakcji jest ustalany przez Klienta, nie może być jednak niższy niż minimalny rozmiar transakcji określony w Specyfikacji.

Spread czyli różnica między ceną kupna i sprzedaży obowiązuje z reguły w godzinach pracy rynku lokalnego dla danego instrumentu. Spready mogą podlegać rozszerzeniu w zależności od rozwoju sytuacji rynkowej. Dom Maklerski IDM S.A. dopuszcza możliwość negocjowania spreadów podanych w Specyfikacji.

Godziny obrotu. Obrót instrumentami rynku forex odbywa się standardowo przez 24 godziny na dobę w dni powszednie. Obrót w zakresie kontaktów CFD odbywa się w godzinach pracy danego rynku regulowanego.

Poziom wykorzystania środków jest to iloraz wymaganego depozytu zabezpieczającego dla danej pozycji i salda rejestru operacyjnego w przypadku handlu samymi instrumentami finansowymi z wykorzystaniem dźwigni finansowej.

W przypadku gdy poziom wykorzystania środków sięgnie lub przekroczy 150%, system od tego poziomu zaczyna automatycznie zamykać wszystkie pozycje Klienta.

Przykład:

Założmy, że Klient kupił 180 000 USDPLN po kursie 3,0000. Depozyt zabezpieczający dla USDPLN wynosi 1% od nominału transakcji. Walutą bazową rachunku jest PLN oraz Klient posiada kapitał w wysokości 10 000 PLN na rachunku. Symulacja będzie uwzględniała każdorazową zmianę instrumentu bazowego o 20 pipsów (0,0020).

Cena	Z/S	Saldo rej.	Ekspozycja	Wymagany depozyt	Wykorzystanie [%]	Z/S [%]
3,0100	1800	11 800	541 800,00	5 418,00	46	18
3,0080	1440	11 440	541 440,00	5 414,40	47	14
3,0060	1080	11 080	541 080,00	5 410,80	49	11
3,0040	720	10 720	540 720,00	5 407,20	50	7
3,0020	360	10 360	540 360,00	5 403,60	52	4
3,0000	0	10 000	540 000,00	5 400,00	54	0
2,9980	-360	9 640	539 640,00	5 396,40	56	-4
2,9960	-720	9 280	539 280,00	5 392,80	58	-7
2,9940	-1080	8 920	538 920,00	5 389,20	60	-11
2,9920	-1440	8 560	538 560,00	5 385,60	63	-14
2,9900	-1800	8 200	538 200,00	5 382,00	66	-18
2,9880	-2160	7 840	537 840,00	5 378,40	69	-22
2,9860	-2520	7 480	537 480,00	5 374,80	72	-25
2,9840	-2880	7 120	537 120,00	5 371,20	75	-29
2,9820	-3240	6 760	536 760,00	5 367,60	79	-32
2,9800	-3600	6 400	536 400,00	5 364,00	84	-36
2,9780	-3960	6 040	536 040,00	5 360,40	89	-40
2,9760	-4320	5 680	535 680,00	5 356,80	94	-43
2,9740	-4680	5 320	535 320,00	5 353,20	101	-47
2,9720	-5040	4 960	534 960,00	5 349,60	108	-50
2,9700	-5400	4 600	534 600,00	5 346,00	116	-54
2,9680	-5760	4 240	534 240,00	5 342,40	126	-58
2,9660	-6120	3 880	533 880,00	5 338,80	138	-61
2,9640	-6480	3 520	533 520,00	5 335,20	152	-65
2,9620	-6840	3 160	533 160,00	5 331,60	169	-68
2,9600	-7200	2 800	532 800,00	5 328,00	190	-72
2,9580	-7560	2 440	532 440,00	5 324,40	218	-76
2,9560	-7920	2 080	532 080,00	5 320,80	256	-79
2,9540	-8280	1 720	531 720,00	5 317,20	309	-83
2,9520	-8640	1 360	531 360,00	5 313,60	391	-86
2,9500	-9000	1 000	531 000,00	5 310,00	531	-90

2,9480	-9360	640	530 640,00	5 306,40	829	-94
2,9460	-9720	280	530 280,00	5 302,80	1894	-97

Pozycja Klienta zostałaby automatycznie zamknięta, gdyby kurs USDPLN spadł w okolice 2,9640 przy 152% poziomie wykorzystania środków.

Poniższy wykres graficznie przedstawia zależność pomiędzy poziomem wykorzystania środków w procentach a fluktuacjami poziomu zysków/strat (Z/S) w procentach na rachunku Klienta. Trzeba mieć na uwadze, że linia obrazująca poziom wykorzystania środków jest funkcją wykładniczą.

