

Uchwała Nr 8/18
Zarządu KDPW_CCP S.A.
z dnia 6 marca 2018 r.

w sprawie określenia zakresu danych niezbędnych do oceny spełniania przez uczestników rozliczających warunków finansowych w ramach systemu rozliczeń (obrot niezorganizowany)

Na podstawie § 2 ust. 1 i 4, § 32 ust. 2 Regulaminu Rozliczeń Transakcji (obrot niezorganizowany) oraz § 19 ust. 2 Statutu KDPW_CCP S.A., Zarząd KDPW_CCP S.A. postanawia, co następuje:

§ 1

Zakres danych, spośród informacji finansowych, o których mowa w § 32 ust. 1 pkt 3 Regulaminu rozliczeń transakcji (obrot niezorganizowany), jakie są niezbędne do oceny przez KDPW_CCP S.A. spełniania przez uczestników rozliczających warunków finansowych, określa załącznik do niniejszej uchwały.

§ 2

Traci moc uchwała Nr 13/17 Zarządu KDPW_CCP S.A. z dnia 9 maja 2017 r. w sprawie określenia zakresu danych niezbędnych do oceny spełniania przez uczestników rozliczających warunków finansowych w ramach systemu rozliczeń (obrot niezorganizowany).

§ 3

Uchwała wchodzi w życie z dniem 20 marca 2018 r.

Sławomir Panasiuk Michał Stępniewski
Wiceprezes Zarządu Wiceprezes Zarządu

Zakres danych niezbędnych do oceny spełniania przez uczestników rozliczających warunków finansowych w ramach systemu rozliczeń (obróć niezorganizowany)

I. Zakres danych niezbędnych do oceny spełniania warunków finansowych przez uczestnika rozliczającego będącego bankiem krajowym:

1) Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 680/2014 z dnia 16 kwietnia 2014 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne dotyczące sprawozdawczości nadzorczej instytucji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli uczestnik rozliczający jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym):

- a) z załącznika I wzory od 1 do 4 w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym,
- b) z załącznika III lub z załącznika IV wzory 1.1-1.3, 2, 3 w ujęciu skonsolidowanym.

2) Miesięczne **informacje finansowe** określone w uchwale Zarządu Narodowego Banku Polskiego wydanej na podstawie ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 r. o Narodowym Banku Polskim, określającej tryb i szczegółowe zasady przekazywania przez banki danych niezbędnych do oceny ich sytuacji finansowej oraz stabilności i ryzyka systemu bankowego, w zakresie dotyczącym informacji służących do oceny sytuacji finansowej banków oraz ich adekwatności kapitałowej – formularz F 02.00 z pakietu sprawozdawczego FINREP JEDNOSTKOWY.

II. Zakres danych niezbędnych do oceny spełniania warunków finansowych przez uczestnika rozliczającego będącego firmą inwestycyjną:

1) Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 680/2014 z dnia 16 kwietnia 2014 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne dotyczące sprawozdawczości nadzorczej instytucji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli uczestnik rozliczający jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym):

- a) z załącznika I wzory od 1 do 4 w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym,
- b) z załącznika III lub z załącznika IV wzory 1.1-1.3, 2, 3 w ujęciu skonsolidowanym.¹

¹ W przypadku nie sporządzania załącznika III lub załącznika IV spośród ww. należy dostarczyć kwartalne informacje o wybranych skonsolidowanych danych finansowych, o których mowa w § 90 rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 5 lutego 2010 r.

2) Sprawozdanie miesięczne, o którym mowa w § 90 rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 5 lutego 2010 r. w sprawie zakresu, trybu i formy oraz terminów przekazywania informacji przez firmy inwestycyjne, banki, o których mowa w art. 70 ust. 2 ustawy o obrocie instrumentami finansowymi, i banki powiernicze.

III. Zakres danych niezbędnych do oceny spełniania warunków finansowych przez uczestnika rozliczającego będącego podmiotem z siedzibą lub centralą poza granicami Rzeczypospolitej Polskiej, który posiada status uczestnika rozliczającego w ramach prowadzonej przez niego działalności w formie oddziału:

1) Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 680/2014 z dnia 16 kwietnia 2014 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne dotyczące sprawozdawczości nadzorczej instytucji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli uczestnik rozliczający jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym):

- a) z załącznika I wzory od 1 do 4 w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym,
- b) z załącznika III lub z załącznika IV wzory 1.1-1.3, 2, 3 w ujęciu skonsolidowanym.

2) W przypadku oddziału otwartego na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej – dodatkowo informacje finansowe określone w uchwale Zarządu Narodowego Banku Polskiego wydanej na podstawie ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 r. o Narodowym Banku Polskim, określającej tryb i szczegółowe zasady przekazywania przez banki danych niezbędnych do oceny ich sytuacji finansowej oraz stabilności i ryzyka systemu bankowego, w zakresie dotyczącym informacji służących do oceny sytuacji finansowej banków oraz ich adekwatności kapitałowej – formularz F 02.00 z pakietu sprawozdawczego FINREP JEDNOSTKOWY (o ile oddział jest obowiązany do jego sporządzania).

IV. Zakres danych niezbędnych do oceny spełniania warunków finansowych przez uczestnika rozliczającego będącego podmiotem z siedzibą lub centralą poza granicami Rzeczypospolitej Polskiej i posiadający status uczestnika rozliczającego w ramach prowadzonej przez niego działalności bez formy oddziału:

Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 680/2014 z dnia 16 kwietnia 2014 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne dotyczące sprawozdawczości nadzorczej instytucji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli uczestnik rozliczający jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym):

- a) z załącznika I wzory od 1 do 4 w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym,
- b) z załącznika III lub z załącznika IV wzory 1.1-1.3, 2, 3 w ujęciu skonsolidowanym.

w sprawie zakresu, trybu i formy oraz terminów przekazywania informacji przez firmy inwestycyjne, banki, o których mowa w art. 70 ust. 2 ustawy o obrocie instrumentami finansowymi, i banki powiernicze.

