

CCP/ZW/543/2014

Warszawa, 12 czerwca 2014 r.

Uczestnicy KDPW\_CCP

Szanowni Państwo,

uprzejmie informujemy, że w związku z zawartą przez KDPW\_CCP S.A. z Giełdą Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. (zwaną dalej „Giełdą”) oraz z BondSpot S.A. z siedzibą w Warszawie (zwanym dalej „BondSpot”) umową trójstronną w sprawie prowadzenia funduszu zabezpieczającego rozliczanie transakcji zawartych w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych S.A. oraz w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez BondSpot S.A. (zwanego dalej „Funduszem zabezpieczającym ASO GPW BondSpot”), **nastąpi utworzenie Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot.**

W związku z tym Zarząd KDPW\_CCP S.A. uprzejmie informuje, że:

(i) zostanie przeprowadzona likwidacja dotychczasowych funduszy zabezpieczających ASO, czyli funduszu zabezpieczającego rozliczanie transakcji zawartych w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych S.A. oraz funduszu zabezpieczającego rozliczanie transakcji zawieranych w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez BondSpot S.A. (zwanymi dalej „funduszami likwidowanymi”). Otwarcie likwidacji funduszy zostało wyznaczone **na dzień 30 czerwca 2014 r.** (informacja o publikacji

KDPW\_CCP S.A.  
ul. Książęca 4  
00-498 Warszawa  
T 22 537 91 27  
F 22 627 31 11  
E ccp@kdpw.pl  
www.kdpwccp.pl

zasad likwidacji tych funduszy została Państwu przekazana w naszym piśmie o sygnaturze CCP/ZW/357/2014 z dnia 23 kwietnia 2014 r.);

(ii) treść nowego Regulaminu Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot (zwanego dalej „regulaminem”) jest dostępna na stronie internetowej KDPW\_CCP S.A. w zakładce „Regulacje”, wejdzie on w życie w dniu otwarcia likwidacji funduszy likwidowanych, określonym w uchwałach Zarządu KDPW\_CCP S.A. - czyli **w dniu 30 czerwca 2014 r.**, z zastrzeżeniem, że postanowienia regulaminu dotyczące złożenia deklaracji uczestnictwa w nowym funduszu (§ 2 ust. 2 pkt 2 tego regulaminu oraz załącznik do tego regulaminu) wejdą w życie **w dniu 26 czerwca 2014 r.**;

(iii) na podstawie Regulaminu Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot uczestnicy są zobowiązani do złożenia deklaracji uczestnictwa w nowym funduszu **do dnia 27 czerwca 2014 r. (w załączeniu wzór deklaracji z uprzejmą prośbą o jego podpisanie i przekazanie do KDPW CCP S.A. najpóźniej do tego dnia. Wzór deklaracji jest również dostępny na stronie internetowej KDPW CCP S.A. jako załącznik nr 2 do regulaminu)**;

(iv) na podstawie Regulaminu Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot **w dniu 1 lipca 2014 r.** nastąpi realizacja płatności w ramach pierwszej wpłaty podstawowej do Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot oraz ewentualny zwrot środków z funduszy likwidowanych. Uczestnicy wnoszą pierwszą wpłatę do zasobu podstawowego funduszu wyłącznie w formie pieniężnej.

Regulamin Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot zabezpiecza wykonywanie zobowiązań wynikających z prowadzonych przez KDPW\_CCP S.A. rozliczeń transakcji zawieranych w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez odpowiednio GPW lub BondSpot, w tym także zawartych przed dniem otwarcia likwidacji funduszy likwidowanych.

Pierwszymi uczestnikami Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot będą uczestnicy KDPW\_CCP będący dotychczasowymi uczestnikami funduszy likwidowanych do dnia otwarcia likwidacji, **którzy do dnia 27 czerwca 2014 r. złożą deklaracje przystąpienia do tego funduszu.** Utworzenie Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot nastąpi z chwilą regulacji pierwszych wpłat do tego funduszu przez tych uczestników w dniu 1 lipca 2014 r. Regulacja pierwszej wpłaty podstawowej nastąpi automatycznie, poprzez kompensatę wierzytelności KDPW\_CCP S.A. wobec uczestników o dokonanie pierwszych wpłat podstawowych do Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot z wierzytelnościami uczestników o zwrot wpłat wniesionych do zasobu podstawowego odpowiedniego funduszu likwidowanego w związku z jego likwidacją. KDPW\_CCP S.A. bezzwłocznie udostępni uczestnikom informacje o dokonaniu kompensaty w standardowym komunikacie postrozliczeniowym w dniu likwidacji.



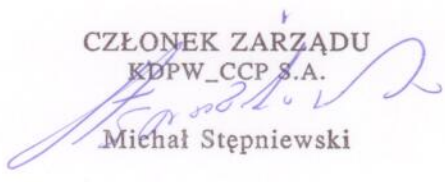
Jednocześnie uprzejmie informujemy, że utworzenie nowego Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot nie nastąpi w przypadku, gdyby likwidacja któregoś z funduszy likwidowanych nie doszła do skutku (co może mieć miejsce w sytuacji, gdyby przed utworzeniem tego funduszu nastąpił przypadek niewypłacalności jednego z uczestników likwidowanego funduszu). Wówczas regulamin Funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot utraci moc, zaś przeprowadzenie procesu likwidacji dotychczasowych funduszy będzie wymagało ponownego podjęcia przez Zarząd KDPW\_CCP S.A. nowych uchwał o wyznaczeniu nowego terminu, w którym nastąpi ich likwidacja, oraz ponownego opublikowania regulaminu.

W załączeniu przekazujemy szczegółowy harmonogram likwidacji dotychczasowych funduszy likwidowanych oraz utworzenia w ich miejsce nowego.

Z-ca Dyrektora Zarządzającego  
KDPW\_CCP S.A.

  
Żaneta Skorupska-Świrska

CZŁONEK ZARZĄDU  
KDPW\_CCP S.A.

  
Michał Stępniewski

Załączniki:

- wzór deklaracji przystąpienia do nowego funduszu,
- szczegółowy harmonogram likwidacji dotychczasowych funduszy likwidowanych oraz utworzenia w ich miejsce nowego.

## Załącznik nr 2 do regulaminu

### Wzór deklaracji przystąpienia do Funduszu

.....  
(miejsowość, data)

.....  
(nazwa/firma oraz  
pozostałe dane identyfikujące  
uczestnika składającego deklarację)

Do:  
KDPW\_CCP S.A.  
ul. Książęca 4  
00-498 Warszawa

#### DEKLARACJA PRZYSTĄPIENIA DO FUNDUSZU

W związku z tym, że w ramach posiadanego przez nas statusu uczestnika rozliczającego zamierzamy prowadzić działalność w zakresie transakcji zawieranych w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. lub/i w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez BondSpot S.A.

oświadczamy, że:

- 1/ zapoznaliśmy się z Regulaminem funduszu zabezpieczającego rozliczanie transakcji zawartych w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. oraz w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez BondSpot S.A. i akceptujemy jego treść,
- 2/ przyjmujemy postanowienia tego regulaminu i uznajemy je za wiążące, a w szczególności zobowiązujemy się wnosić wpłaty do funduszu zabezpieczającego rozliczanie transakcji zawartych w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. oraz w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez BondSpot S.A. na zasadach określonych w tym regulaminie oraz wykonywać inne wynikające z niego zobowiązania dla uczestnika.

.....  
(podpis/y za uczestnika  
zgodnie z zasadami jego  
reprezentacji)



Szczegółowy harmonogram połączenia Funduszu Zabezpieczającego Rozliczanie Transakcji Zawartych w Alternatywnym Systemie Obrotu organizowanym przez GPW w Warszawie S.A. oraz Funduszu Zabezpieczającego Rozliczanie Transakcji Zawartych w Alternatywnym Systemie Obrotu organizowanym przez BondSpot S.A.

Data	Czynność
12 czerwca 2014 r.	<p>Podjęcie przez Zarząd KDPW_CCP uchwał o wyznaczeniu dnia likwidacji:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) Funduszu Zabezpieczającego Rozliczanie Transakcji Zawartych w Alternatywnym Systemie Obrotu organizowanym przez GPW w Warszawie S.A. oraz</li> <li>2) Funduszu Zabezpieczającego Rozliczanie Transakcji Zawartych w Alternatywnym Systemie Obrotu organizowanym przez BondSpot S.A.</li> </ol> <p>na dzień 30 czerwca 2014 r. i ich opublikowanie</p>
12 czerwca 2014 r	Opublikowanie regulaminu funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot (który zgodnie z § 37 ust. 1 tego regulaminu, wchodzi w życie w dniu otwarcia likwidacji funduszy likwidowanych)
26 czerwca 2014 r.	Wejście w życie postanowień regulaminu o składaniu deklaracji przez Uczestników Rozliczających oraz wzoru deklaracji (stanowiącej załącznik do regulaminu funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot)
Do 27 czerwca 2014 r.	Termin złożenia przez Uczestników Rozliczających deklaracji przystąpienia do funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot
27 czerwca 2014 r. godz. 16:00	Przekazanie przez KDPW_CCP do GPW oraz do BondSpot listy uczestników, którzy złożyli deklaracje przystąpienia do funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot
30 czerwca 2014 r. godz.18:00	Przekazanie przez KDPW_CCP do GPW oraz do BondSpot zaktualizowanej listy uczestników, którzy złożyli deklaracje przystąpienia do funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot
30 czerwca 2014 r. (w ramach wieczornej sesji rozliczeniowej)	Wykonanie sesji kompensacyjnej: otwarcie likwidacji dwóch funduszy ASO - wykonanie aktualizacji udziałów Uczestników Rozliczających oraz ustalenie wysokości pierwszej wpłaty do funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot

<b>01 lipca 2014 r.</b>	do godz. 8.30 - wykonanie płatności w ramach pierwszej wpłaty na fundusz zabezpieczający ASO GPW BondSpot (łącznie z płatnościami dotyczącymi WDW, CCR/premii, Funduszu Rozliczeniowego, Depozytów Dodatkowych) i utworzenie funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot
<b>01 lipca 2014 r.</b>	Do końca dnia - rozliczenie zasobu rezerwowego Funduszu Zabezpieczającego Rozliczanie Transakcji Zawartych w Alternatywnym Systemie Obrotu organizowanym przez GPW w Warszawie S.A. oraz Funduszu Zabezpieczającego Rozliczanie Transakcji Zawartych w Alternatywnym Systemie Obrotu organizowanym przez BondSpot S.A.