

Uchwała Nr 16/22
Zarządu KDPW_CCP S.A.
z dnia 11 kwietnia 2022 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 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).

§ 3

Uchwała wchodzi w życie dwa tygodnie po jej opublikowaniu przez Zarząd KDPW_CCP S.A.

Maciej Trybuchowski
Prezes Zarządu

Sławomir Panasiuk
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 2021/451 z dnia 17 grudnia 2020 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 w odniesieniu do sprawozdań nadzorczych instytucji oraz uchylające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 680/2014, 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 2021/2284 z dnia 10 grudnia 2021 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/2033 w odniesieniu do sprawozdawczości nadzorczej firm inwestycyjnych oraz ujawniania informacji przez firmy inwestycyjne, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli uczestnik rozliczający jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym):
 - a) z załącznika I wzory 1 (I 01.00), 2,1 (I 02.01) i 2,2 (I 02.02) w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym lub z załącznika III wzory 1 (I 01.01), 2,3 (I 02.03) i 2,4 (I 02.04) w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym,
 - b) z załącznika VIII wzory 11,1 (I 11.01), 11,2 (I 11.02) i 11,3 (I 11.03).

- 2) Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 2021/451 z dnia 17 grudnia 2020 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 w odniesieniu do sprawozdań nadzorczych instytucji oraz uchylające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 680/2014, 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.
- 3) Sprawozdanie miesięczne, o którym mowa w § 139 rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 22 lutego 2019 r. w sprawie zakresu, trybu i formy oraz terminów przekazywania Komisji Nadzoru Finansowego informacji przez firmy inwestycyjne, banki, o których mowa w art. 70 ust. 2 ustawy o obrocie instrumentami finansowymi, i banki powiernicze.
- 4) Kwartalne informacje o wybranych skonsolidowanych danych finansowych, o których mowa w § 139 rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 22 lutego 2019 r. w sprawie zakresu, trybu i formy oraz terminów przekazywania Komisji Nadzoru Finansowego informacji przez firmy inwestycyjne, banki, o których mowa w art. 70 ust. 2 ustawy o obrocie instrumentami finansowymi, i banki powiernicze (jeżeli uczestnik rozliczający jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym).

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 2021/451 z dnia 17 grudnia 2020 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 w odniesieniu do sprawozdań nadzorczych instytucji oraz uchylające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 680/2014, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli podmiot 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) Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 2021/2284 z dnia 10 grudnia 2021 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/2033 w odniesieniu do sprawozdawczości nadzorczej firm inwestycyjnych oraz ujawniania informacji przez firmy inwestycyjne, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli podmiot jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym):

- a) z załącznika I wzory 1 (I 01.00), 2,1 (I 02.01) i 2,2 (I 02.02) w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym lub z załącznika III wzory 1 (I 01.01), 2,3 (I 02.03) i 2,4 (I 02.04) w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym,
 - b) z załącznika VIII wzory 11,1 (I 11.01), 11,2 (I 11.02) i 11,3 (I 11.03).
- 3)** Informacje finansowe zawierające rachunek zysków i strat w ujęciu skonsolidowanym sporządzane i przekazywane do właściwych władz nadzorujących, o ile podmiot nie jest obowiązany do przekazywania sprawozdań z tego zakresu określonych w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 2021/451 z dnia 17 grudnia 2020 r. ustanawiającym wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 w odniesieniu do sprawozdań nadzorczych instytucji oraz uchylające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 680/2014 (jeżeli podmiot jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym).
- 4)** 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:

- 1)** Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 2021/451 z dnia 17 grudnia 2020 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 w odniesieniu do sprawozdań nadzorczych instytucji oraz uchylające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 680/2014, 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)** Sprawozdania określone w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 2021/2284 z dnia 10 grudnia 2021 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/2033 w odniesieniu do sprawozdawczości nadzorczej firm inwestycyjnych oraz ujawniania informacji przez firmy inwestycyjne, sporządzone według następujących wzorów (jeżeli uczestnik rozliczający jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym):

- a) z załącznika I wzory 1 (I 01.00), 2,1 (I 02.01) i 2,2 (I 02.02) w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym lub z załącznika III wzory 1 (I 01.01), 2,3 (I 02.03) i 2,4 (I 02.04) w ujęciu jednostkowym i skonsolidowanym,
- b) z załącznika VIII wzory 11,1 (I 11.01), 11,2 (I 11.02) i 11,3 (I 11.03).

3) Informacje finansowe zawierające rachunek zysków i strat w ujęciu skonsolidowanym sporządzone i przekazywane do właściwych władz nadzorujących, o ile uczestnik rozliczający nie jest obowiązany do przekazywania sprawozdań z tego zakresu określonych w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) nr 2021/451 z dnia 17 grudnia 2020 r. ustanawiającym wykonawcze standardy techniczne do celów stosowania rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 w odniesieniu do sprawozdań nadzorczych instytucji oraz uchylające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 680/2014 (jeżeli podmiot jest obowiązany do ich przekazywania właściwym władzom nadzorującym).