

Uchwała Nr 17/596/23**Rady Nadzorczej KDPW_CCP S.A.****z dnia 14 czerwca 2023 r.**

Na podstawie art. 48 ust. 15 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi (tekst jednolity: Dz.U. z 2023 r. poz. 646 z późn. zm.) oraz § 15 ust. 2 pkt 13 Statutu KDPW_CCP S.A., Rada Nadzorcza KDPW_CCP S.A. postanawia, co następuje:

§ 1

W Regulaminie rozliczeń transakcji (obróć niezorganizowany), stanowiącym załącznik do uchwały Nr 21/55/12 Rady Nadzorczej KDPW_CCP S.A. z dnia 29 sierpnia 2012 r. (z późn. zm.), dokonuje się następujących zmian:

1/ w § 1:

a/ po pkt 6 dodaje się pkt 6a w brzmieniu:

„6b/ **dniu roboczym** – rozumie się przez to dzień ustalony zgodnie z właściwymi przepisami prawa oraz przepisami niniejszego regulaminu,”;

b/ pkt 8-10 otrzymują brzmienie:

„8/ **funduszu zabezpieczającym OTC** – rozumie się przez to fundusz zabezpieczający prawidłowe rozliczanie transakcji zawieranych poza obrotem zorganizowanym, o którym mowa w art. 68 ust. 7 ustawy,

9/ **instrukcji rozliczeniowej** – rozumie się przez to zlecenie rozrachunku w rozumieniu ustawy z dnia 24 sierpnia 2001 r. o ostateczności rozrachunku w systemach płatności i systemach rozrachunku papierów wartościowych oraz zasadach nadzoru nad tymi systemami (tekst jednolity: Dz.U. z 2022 r., poz. 1581), będące, odpowiednio:

a/ dokumentem zawierającym warunki transakcji, którego struktura i format została ustalona w porozumieniu z podmiotem prowadzącym platformę elektroniczną, otrzymanym z tej platformy, albo

b/ dyspozycją stanowiącą potwierdzenie przyjęcia oferty zawarcia transakcji dla przeciwstawnej pozycji, dostarczoną przez uczestnika rozliczającego zgodnie z niniejszym regulaminem oraz Szczegółowymi Zasadami Systemu Rozliczeń OTC, w ramach obsługi zamykania pozycji na żądanie, o której mowa w § 90 ust. 1, albo



c/ dokumentem wystawionym przez KDPW_CCP na podstawie dostarczonych przez uczestników rozliczających do KDPW_CCP odpowiednio zgodnych dyspozycji zawierających warunki transakcji repo w rozumieniu niniejszego regulaminu,

10/ **instrumentach pochodnych** – rozumie się przez to wskazane w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC instrumenty finansowe, w rozumieniu art. 2 ust. 1 pkt 2 lit. c), d), g), h) lub i) ustawy, niebędące papierami wartościowymi, rozliczane w środkach pieniężnych w określonej walucie, które nie zostały dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym lub wprowadzone do alternatywnego systemu obrotu przez podmiot prowadzący na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej, odpowiednio, ten rynek lub ten system obrotu, należące do klasy instrumentów pochodnych, którą KDPW_CCP jest uprawniony rozliczać,”;

c/ pkt 13-14 otrzymują brzmienie:

„13/ **kompensacji** – rozumie się przez to kompensację wzajemnych należności wynikających z rozliczanych transakcji oraz z uczestnictwa w systemie rozliczeń OTC, dokonywaną zgodnie z regulaminem oraz Szczegółowymi Zasadami Systemu Rozliczeń OTC,

14/ **koncie rozliczeniowym** – rozumie się przez to urządzenie ewidencyjne prowadzone przez KDPW_CCP w systemie rozliczeń OTC na rzecz uczestnika w celu przeprowadzenia rozliczeń transakcji, których jest stroną lub stroną rozliczenia, oraz rejestrowania jego pozycji,”;

d/ po pkt 21 dodaje się pkt 21a w brzmieniu:

„21a/ **operacji aukcji** - rozumie się przez to działania podejmowane przez KDPW_CCP zgodnie z regulaminem w celu zabezpieczenia realizacji świadczeń pieniężnych wynikających z rozliczeń transakcji dotkniętych oraz zamknięcia pozycji uczestnika naruszającego w związku z rozwiązaniem z nim umowy o uczestnictwo w trybie natychmiastowym,”;

e/ pkt 22 otrzymuje brzmienie:

„22/ **papierach wartościowych będących przedmiotem transakcji** – rozumie się przez to papiery wartościowe w rozumieniu art. 3 pkt 1 lit. a) ustawy będące obligacjami skarbowymi, rejestrowane w depozycie papierów wartościowych prowadzonym przez Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A. lub podmiot zależny od Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A., któremu przekazał on wykonywanie czynności z zakresu zadań, o których mowa w art. 48 ust. 1 pkt 1-6 tej ustawy, z wyłączeniem indeksowanych obligacji skarbowych, będące przedmiotem transakcji repo lub transakcji sprzedaży,”;

f/ pkt 25 otrzymuje brzmienie:

„25/ **poleceniu przelewu** – rozumie się przez to polecenie przelewu, o którym mowa w art. 63c ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 r. Prawo bankowe (tekst jednolity: Dz.U. z 2022 r., poz. 2324 z późn. zm.),”;

g/ pkt 28 otrzymuje brzmienie:

„28/ **propozycji otwarcia pozycji** – rozumie się przez to, odpowiednio:

a/złożoną przez uczestnika rozliczającego w ramach obsługi zamykania pozycji na żądanie, o której mowa w § 90 ust. 1, propozycję składania za pośrednictwem KDPW_CCP ofert zawierających warunki otwarcia pozycji przeciwstawnej dla wybranych pozycji rejestrowanych na koncie rozliczeniowym prowadzonym dla tego uczestnika rozliczającego, albo

b/ złożoną przez KDPW_CCP w ramach operacji aukcji, o której mowa w § 96 ust. 1, propozycję składania ofert zawierających warunki otwarcia pozycji odpowiadającej pozycji lub pozycjom uczestnika naruszającego, które są zamykane.

Propozycja, o której mowa, odpowiednio, w lit. a oraz lit. b, nie stanowi oferty w rozumieniu przepisów ustawy z dnia 23 kwietnia 1964 r. Kodeks cywilny (tekst jednolity: Dz.U. z 2022 r., poz. 1360 z późn. zm.),”;

h/ pkt 34a otrzymuje brzmienie:

„34a/ **systemie GUI** – rozumie się przez to obowiązkowy dla uczestnika rozliczającego dodatkowy system komunikacji elektronicznej, w zakresie określonym w niniejszym regulaminie oraz w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC, funkcjonujący za pośrednictwem strony internetowej KDPW_CCP na podstawie porozumienia zawartego przez uczestnika z KDPW_CCP, wedle którego określone w ramach tego systemu informacje i oświadczenia, o których mowa w niniejszym regulaminie, Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC oraz innych uchwałach wydanych na podstawie regulaminu, są dostarczane w postaci elektronicznej przez KDPW_CCP uczestnikowi lub uczestnikom systemu rozliczeń lub przez uczestnika systemu rozliczeń do KDPW_CCP zgodnie z zawartym porozumieniem,”;

i/ pkt 39-40 otrzymują brzmienie:

„39/ **systemie SWI** – rozumie się przez to obowiązkowy dla uczestnika rozliczającego podstawowy system komunikacji elektronicznej, funkcjonujący na podstawie porozumienia zawartego z Krajowym Depozytem Papierów Wartościowych S.A., na podstawie którego informacje i oświadczenia, o których mowa w niniejszym regulaminie, Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC oraz innych uchwałach wydanych na podstawie regulaminu, są dostarczane w postaci elektronicznej przez KDPW_CCP uczestnikowi lub uczestnikom systemu rozliczeń OTC lub przez uczestnika systemu rozliczeń OTC do KDPW_CCP, za pośrednictwem Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. zgodnie z zawartym z nim porozumieniem,

40/ **systemie zabezpieczania płynności rozliczania transakcji** – rozumie się przez to system, o którym mowa w art. 48 ust. 10 pkt 2 ustawy,”;

j/ pkt 45-46 otrzymują brzmienie:

„45/ **transakcji dla przeciwstawnej pozycji** – rozumie się przez to, odpowiednio:

a/ transakcję pochodną zawartą przez uczestnika rozliczającego w celu zamknięcia przeciwstawnej pozycji, w ramach obsługi zamykania pozycji na żądanie, o której mowa w § 90 ust.1, albo

b/ transakcję zawartą przez KDPW_CCP w ramach operacji aukcji, o której mowa w § 96 ust. 1,

46/ **transakcji dotkniętej** – rozumie się przez to transakcję („transakcja A”) powstałą w wyniku nowacji transakcji przyjętej do systemu rozliczeń OTC, która nie może zostać wykonana w terminie

z powodu niewykonania lub nienależytego wykonania przez uczestnika naruszającego zobowiązania wynikającego z innej transakcji („transakcja B”), która również powstała w wyniku nowacji rozliczeniowej,”;

k/ pkt 53-54a otrzymują brzmienie:

„53/ **ustawie** – rozumie się przez to ustawę z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi (tekst jednolity: Dz.U. z 2023 r. poz. 646 z późn. zm.),

54/ **wnioskodawcy** – rozumie się przez to podmiot ubiegający się o status uczestnika w zorganizowanym przez KDPW_CCP systemie rozliczeń OTC w określonym typie uczestnictwa lub zmianę tego statusu w ramach zawartej z nim umowy o uczestnictwo,

54a/ **wymogu kapitałowym dla KDPW_CCP** – rozumie się przez to ustaloną wysokość kapitału KDPW_CCP, o którym mowa w art. 16 ust. 2 rozporządzenia EMIR, obliczoną przez KDPW_CCP zgodnie z właściwymi przepisami prawa, w sposób zapewniający zabezpieczenie KDPW_CCP przed ryzykiem wynikającym z prowadzonej działalności oraz sprawne przeprowadzenie likwidacji lub restrukturyzacji tej działalności,”;

l/ pkt 54b otrzymuje brzmienie:

„54b/ **zasobie celowym I** – rozumie się przez to ustaloną wysokość środków stanowiących kapitał własny KDPW_CCP przeznaczoną na pokrycie ewentualnych strat powstałych w razie niewykonania przez uczestników rozliczających zobowiązań wynikających z transakcji przyjętych przez KDPW_CCP do rozliczenia, która w razie stwierdzenia przypadku naruszenia powinna zostać użyta przed wykorzystaniem wpłat wniesionych do właściwego funduszu na wypadek niewykonania zobowiązania przez uczestnika rozliczającego, innych niż wpłata wniesiona do tego funduszu przez uczestnika niewykonującego swojego zobowiązania,”;

ł/ dotychczasowa treść pkt 54c otrzymuje oznaczenie 54d, a pkt 54c otrzymuje brzmienie:

„54c/ **zasobie celowym II** – rozumie się przez to ustaloną wysokość środków stanowiących kapitał własny KDPW_CCP, przeznaczoną na pokrycie ewentualnych strat powstałych w razie niewykonania przez uczestników rozliczających zobowiązań wynikających z transakcji przyjętych przez KDPW_CCP do rozliczenia lub w wyniku zdarzenia niezwiązanego z niewykonaniem tych zobowiązań, która w razie stwierdzenia przypadku naruszenia powinna zostać użyta po wykorzystaniu wpłat wniesionych do właściwego funduszu na wypadek niewykonania zobowiązania przez uczestnika rozliczającego,”;

2/ §§ 4 i 5 otrzymują brzmienie:

„§ 4

1. KDPW_CCP udostępnia uczestnikom regulamin, Szczegółowe Zasady Systemu Rozliczeń OTC, oraz uchwały podjęte na podstawie regulaminu, a także ich zmiany, publikując ich treść na stronie internetowej KDPW_CCP lub dostarczając uczestnikom ich treść w formie pisemnej lub za pośrednictwem systemu SWI lub systemu GUI.

2. KDPW_CCP udostępnia uczestnikom wzory oświadczeń, o których mowa w regulaminie,

Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC, oraz uchwałach podjętych na podstawie regulaminu, a także wszelkie inne informacje, do których dostarczenia jest zobowiązany na podstawie tych regulacji, w sposób wskazany w ust. 1, lub pocztą elektroniczną poprzez sieć Internet (na adresy wskazane przez uczestników).

§ 5

1. Oświadczenia oraz informacje są dostarczane przez KDPW_CCP uczestnikowi rozliczającemu albo przez tego uczestnika do KDPW_CCP w postaci elektronicznej za pośrednictwem:

1/ systemu SWI lub

2/systemu GUI,

chyba że w niniejszym regulaminie lub w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC dopuszcza się inną możliwość.

1a. Oświadczenia oraz informacje są dostarczane przez KDPW_CCP uczestnikowi posiadającemu status uczestnika nierozliczającego albo przez tego uczestnika do KDPW_CCP w postaci elektronicznej za pośrednictwem systemu GUI w zakresie określonym w niniejszym regulaminie oraz w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC, chyba że przepisy tego regulaminu lub Szczegółowych Zasad Systemu Rozliczeń OTC stanowią inaczej.

2. KDPW_CCP oświadcza, że uznaje skuteczność składania przez uczestnika rozliczającego oświadczeń woli i przesyłania przez niego informacji w formie elektronicznej za pośrednictwem systemu SWI lub za pośrednictwem systemu GUI.

3. O ile regulamin lub Szczegółowe Zasady Systemu Rozliczeń OTC nie stanowią inaczej:

1/ oświadczenia i informacje składane przez:

a/ wnioskodawcę, KDPW_CCP albo uczestnika, w związku z ubieganiem się o zawarcie, rozszerzenie, ograniczenie lub ustanie ich uczestnictwa, albo w ramach aktualizacji dokumentów złożonych wcześniej przez uczestnika w celu zawarcia lub zmiany umowy o uczestnictwo,

b/ uczestnika rozliczającego, o którym mowa w tytule III „Uczestnictwo”,

c/ uczestnika posiadającego status uczestnika nierozliczającego albo przez KDPW_CCP, w sprawach wymienionych w § 18 ust. 2, z zastrzeżeniem ust. 1a oraz § 110b ust. 11 i 12,

d/ KDPW_CCP lub uczestnika w sprawach dotyczących postępowania reklamacyjnego, o którym mowa w tytule IX „Postępowanie reklamacyjne”,

wymagają dostarczenia do adresata oryginału dokumentu zawierającego treść oświadczenia lub informacji, sporządzonego co najmniej w zwykłej formie pisemnej albo uwierzytelnionego we właściwy sposób odpisu, z zastrzeżeniem ust. 5

2/ dokumenty urzędowe powinny być dostarczone w oryginale lub w postaci uwierzytelnionego we właściwy sposób odpisu.

4. Zarząd KDPW_CCP może w drodze uchwały:

1/ określić przypadki, w których przekazanie oświadczenia lub informacji powinno nastąpić:

a/ w postaci elektronicznej za pośrednictwem systemu SWI lub systemu GUI,

b/ w formie pisemnej,

2/ dopuścić przekazywanie przez uczestników lub przez podmioty ubiegające się o zawarcie umowy o uczestnictwo niektórych dokumentów, w tym dokumentów urzędowych, w postaci ich elektronicznej kopii (skanu).

5. W stosunkach między KDPW_CCP a uczestnikami dopuszcza się przesłanie dokumentu zawierającego treść oświadczenia lub informacji, o których mowa w ust. 3 lub 4, pocztą elektroniczną poprzez sieć Internet. Jednakże do czasu otrzymania dokumentu w sposób wskazany w ust. 3 lub 4, na podstawie treści przekazu elektronicznego podejmuje się jedynie czynności niecierpiące zwłoki. Nie podejmuje się żadnych czynności w wypadku, gdy przekaz elektroniczny uległ zniekształceniu w stopniu uniemożliwiającym ustalenie jego treści.

6. Jeżeli oświadczenie lub informacja powinna zostać przekazana w postaci elektronicznej, a nie może zostać przekazana za pośrednictwem systemu GUI, jej przekazanie powinno nastąpić za pośrednictwem systemu SWI, chyba że regulamin lub Szczegółowe Zasady Systemu Rozliczeń OTC stanowią inaczej. W sytuacjach szczególnych, w szczególności w razie wystąpienia awarii, dopuszcza się, za obopólną zgodą KDPW_CCP i uczestnika, przesłanie w stosunkach pomiędzy nimi dokumentu zawierającego treść oświadczenia lub informacji w innej formie niż wymagana w określonych przepisach Regulaminu lub Szczegółowych Zasad Systemu Rozliczeń OTC.

7. Przez uwierzytelniony we właściwy sposób odpis dokumentu rozumie się:

1/ w przypadku dokumentów urzędowych – odpis urzędowo albo notarialnie poświadczony za zgodność z oryginałem, a w przypadku dokumentów zawierających informacje z Krajowego Rejestru Sądowego lub z innego rejestru, który jest właściwy dla uczestnika lub podmiotu ubiegającego się o zawarcie umowy o uczestnictwo - także wydruk komputerowy spełniający wymogi, od których zależy przypisanie mu mocy zrównanej z mocą dokumentów zgodnie z właściwymi przepisami prawa,

2/ w przypadku dokumentów prywatnych – odpis poświadczony notarialnie za zgodność z oryginałem, a w przypadku dokumentów zawierających własne oświadczenia podmiotu składającego odpis dokumentu - również odpis poświadczony za zgodność z oryginałem zgodnie z zasadami reprezentacji tego podmiotu.

8. Oświadczenia i informacje w formie pisemnej są przekazywane przez KDPW_CCP pod adres wskazany w dokumentach złożonych przez uczestnika. W przypadku, gdy oświadczenie lub informacja nie mogła zostać doręczona uczestnikowi pod takim adresem, uznaje się, że z dniem otrzymania przez KDPW_CCP informacji o takiej niemożności nastąpiły wszelkie skutki złożenia uczestnikowi oświadczenia lub przekazania mu informacji przez KDPW_CCP.”;

3/ po § 13 dodaje się § 13a w brzmieniu:

„§ 13a

KDPW_CCP nie jest zobowiązany do naprawienia szkody powstałej na skutek działań, o których mowa w przepisach tytułu IVa, chyba że została ona wyrządzona z winy umyślnej lub rażącego niedbalstwa KDPW_CCP.”;

4/ § 23 otrzymuje brzmienie:

„§ 23

1. Do wniosku w sprawie zawarcia umowy o uczestnictwo załącza się:

- 1/ odpis statutu albo umowy spółki oraz aktualny odpis lub wyciąg z właściwego rejestru,
- 2/ odpis zezwolenia na prowadzenie działalności, udzielonego zgodnie z, odpowiednio, dyrektywą 2004/39/WE z dnia 21 kwietnia 2004 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych zmieniająca dyrektywę Rady 85/611/EWG i 93/6/EWG i dyrektywę 2000/12/WE Parlamentu Europejskiego i Rady oraz uchylająca dyrektywę Rady 93/22/EWG, dyrektywą Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 26 czerwca 2013 r. w sprawie warunków dopuszczenia instytucji kredytowych do działalności oraz nadzoru ostrożnościowego nad instytucjami kredytowymi i firmami inwestycyjnymi, zmieniająca dyrektywę 2002/87/WE i uchylająca dyrektywy 2006/48/WE oraz 2006/49/WE, albo dyrektywą 73/239/EWG z dnia 22 czerwca 1987 r. w sprawie koordynacji przepisów ustawowych, wykonawczych i administracyjnych odnoszących się do ubezpieczenia ochrony prawnej, albo dyrektywą 2002/83/WE z dnia 5 listopada 2002 r. dotyczącą ubezpieczeń na życie, albo dyrektywą 2005/68/WE z dnia 16 listopada 2005 r. w sprawie reasekuracji oraz zmieniająca dyrektywy Rady 73/239/EWG, 92/49/EWG, a także dyrektywy 98/78/WE i 2002/83/WE, albo dyrektywą 2009/65/WE z dnia 13 lipca 2009 r. w sprawie koordynacji przepisów ustawowych, wykonawczych i administracyjnych odnoszących się do przedsiębiorstw zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS), albo dyrektywą 2011/61/UE z dnia 8 czerwca 2011 r. w sprawie zarządzających alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi i zmiany dyrektyw 2003/41/WE i 2009/65/WE oraz rozporządzeń (WE) nr 1060/2009 i (UE) nr 1095/2010, a także właściwymi przepisami prawa obowiązującymi w państwie, w którym znajduje się, odpowiednio, siedziba lub oddział wnioskodawcy. Ponadto, jeżeli w związku z prowadzeniem przez wnioskodawcę działalności na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej wymagane jest zajęcie dodatkowych przesłanek – oświadczenie o zajściu przesłanek umożliwiających podjęcie działalności na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej,
- 3/ kartę wzorów podpisów osób upoważnionych do reprezentowania wnioskodawcy, jak również odpisy pełnomocnictw w przypadku, gdy z dokumentów określonych w pkt 1 nie wynika prawo do reprezentowania wnioskodawcy przez osoby składające wzór podpisu na karcie wzorów podpisów,
- 4/ oświadczenie w przedmiocie poddania sporów, o których mowa w § 8 ust. 2, jurysdykcji sądu powszechnego, który jest właściwy według miejsca siedziby KDPW_CCP,
- 5/ kartę informacyjną zawierającą wskazanie adresu do doręczeń, a w przypadku, gdy wnioskodawca ubiega się o typ uczestnictwa uczestnik nierozliczający - także numer rachunku bankowego prowadzonego dla tego wnioskodawcy w walucie, w której są przeprowadzane rozliczenia transakcji, oraz wykaz osób upoważnionych przez tego wnioskodawcę do kontaktów z KDPW_CCP, z podaniem ich stanowisk, numerów telefonów i telefaksów oraz adresów e-mail,
- 5a/ w przypadku, gdy podmiot ubiega się o typ uczestnictwa uczestnik nierozliczający – oświadczenie, w którym uczestnik rozliczający reprezentujący ten podmiot w rozliczeniach wyraża zgodę na dostęp tego podmiotu do danych tego uczestnika rozliczającego w ramach systemu GUI w związku z tą reprezentacją,
- 6/ oświadczenie w sprawie miejsca siedziby działalności gospodarczej lub stałego miejsca prowadzenia działalności gospodarczej w rozumieniu rozporządzenia wykonawczego Rady (UE) Nr 282/2011 z dnia 15 marca 2011 r. ustanawiającego środki wykonawcze do dyrektywy 2006/112/WE w sprawie wspólnego systemu podatku od wartości dodanej (Dz.U. UE L 77 z 2011 r., str. 1, z późn. zm.), dla którego ma zostać zawarta umowa o uczestnictwo – o ile wnioskodawca jest nierezydentem w

rozumieniu ustawy z dnia 27 lipca 2002 r. Prawo dewizowe (tekst jednolity: Dz.U. z 2022 r., poz. 309 z późn. zm.),

7/ oświadczenie potwierdzające, że wnioskodawca stosuje szczególne środki ograniczające zgodnie z właściwymi przepisami prawa, w szczególności wobec osób i podmiotów wskazanych na listach sankcyjnych dotyczących zagrożeń dla międzynarodowego pokoju i bezpieczeństwa spowodowanych aktami terrorystycznymi, publikowanych na podstawie rezolucji Rady Bezpieczeństwa Organizacji Narodów Zjednoczonych, rozporządzeń Rady Unii Europejskiej oraz innych przepisów prawa obowiązujących wnioskodawcę, a także obowiązujących na terytorium Stanów Zjednoczonych Ameryki oraz Wielkiej Brytanii,

8/ oświadczenie wymagane do potwierdzenia, czy w stosunku do wnioskodawcy toczy się postępowanie w związku ze świadczeniem usług finansowych, na podstawie którego mogą zostać wobec niego zastosowane sankcje administracyjne za naruszenie przepisów prawa obowiązujących wnioskodawcę lub została wydana wobec niego decyzja w sprawie zastosowania tych sankcji administracyjnych,

9/ kwestionariusz, który został określony w uchwale Zarządu KDPW_CCP, wymagany w celu pozyskania informacji na temat wnioskodawcy oraz rozpoznania ryzyka prania pieniędzy oraz finansowania terroryzmu związanego z podejmowanymi przez niego stosunkami gospodarczymi,

10/ oświadczenie, zgodne ze wzorem określonym przez KDPW_CCP, potwierdzające, że wszystkie wymogi wynikające z właściwych przepisów prawa obowiązujących wnioskodawcę zostały spełnione i po stronie tego wnioskodawcy nie ma przeszkód formalnych i prawnych do zawarcia tej umowy.

2. Z zastrzeżeniem ust. 3a, jeżeli wniosek dotyczy typu uczestnictwa związanego z posiadaniem statusu uczestnika rozliczającego, wnioskodawca załącza do niego, poza dokumentami określonymi w ust. 1:

1/ wykaz osób zatrudnionych przy obsłudze związanej z rozliczeniem transakcji, z podaniem ich stanowisk, numerów telefonów oraz adresów e-mail,

2/ jeżeli wnioskodawca ma zamiar uczestniczyć w rozliczeniach transakcji repo oraz transakcji sprzedaży lub wносить papiery wartościowe, o których mowa w § 79 ust. 3 pkt 1-3, na poczet depozytów zabezpieczających albo tytułem wpłaty do funduszu zabezpieczającego OTC:

a/ oświadczenie wskazujące identyfikator wnioskodawcy we właściwym systemie rozrachunku albo wskazujące podmiot mający pełnić funkcję agenta do spraw rozrachunku dla wnioskodawcy oraz identyfikator tego podmiotu we właściwym systemie rozrachunku,

b/ oświadczenie podmiotu wskazanego przez wnioskodawcę zgodnie z lit. a, mającego pełnić funkcję agenta do spraw rozrachunku, wyrażające zgodę na pełnienie tej funkcji dla wnioskodawcy, oraz zobowiązujących się do pełnienia tej funkcji w czasie dostępności systemów, w ramach których funkcja ta jest realizowana,

3/ oświadczenie wskazujące numer rachunku bankowego wnioskodawcy, prowadzonego we właściwym banku rozliczeniowym w walucie polskiej, w której zgodnie z regulaminem będzie on realizował zobowiązania i należności pieniężne wynikające z rozliczeń transakcji dokonywanych przez KDPW_CCP, albo wskazujące podmiot mający pełnić funkcję płatnika dla wnioskodawcy i prowadzony dla niego numer rachunku bankowego w banku rozliczeniowym, a w przypadku, jeżeli wnioskodawca zamierza uczestniczyć w rozliczeniach dokonywanych w walucie euro – numer rachunku bankowego prowadzonego dla wnioskodawcy w ramach systemu TARGET, albo wskazujące podmiot mający pełnić funkcję płatnika dla wnioskodawcy i prowadzony dla niego numer rachunku bankowego w tym

systemie,

4/ oświadczenie podmiotu wskazanego przez wnioskodawcę zgodnie z pkt 3, mającego pełnić funkcję płatnika, wyrażające zgodę na pełnienie tej funkcji dla wnioskodawcy, oraz zobowiązujących się do pełnienia tej funkcji w czasie dostępności systemów, w ramach których funkcja ta jest realizowana,

5/ jeżeli wnioskodawca składa wniosek:

a/ po zakończeniu okresu, w którym sprawozdanie finansowe sporządzone za dany okres powinno zostać zbadane zgodnie z właściwymi przepisami prawa obowiązującymi wnioskodawcę - zbadane sprawozdanie finansowe za ten okres, wraz z opinią i raportem biegłego rewidenta, a jeżeli sprawozdanie to nie podlega obowiązkowi badania zgodnie z przepisami prawa obowiązującymi w państwie, w którym znajduje się siedziba tego wnioskodawcy albo, w razie braku obowiązku jej ustanowienia, jego centrala – przyjęte lub zatwierdzone przez właściwy organ,

b/ po upływie sześciu miesięcy od zakończenia ostatniego półrocza roku obrotowego lub rozpoczęcia działalności – półroczne sprawozdania finansowe za ten okres,

6/ jeżeli wnioskodawca zamierza wносить papiery wartościowe, o których mowa w § 79 ust. 3 pkt 4, na poczet depozytów zabezpieczających lub tytułem wpłaty do funduszu zabezpieczającego OTC:

a/ oświadczenie wskazujące, zgodnie z uchwałą Zarządu KDPW_CCP, odpowiedni identyfikator tego wnioskodawcy we właściwym systemie depozytowym dla tych papierów, który został wskazany przez KDPW_CCP, lub numer konta lub rachunku papierów wartościowych prowadzonego dla wnioskodawcy w tym systemie, a w przypadku, jeżeli odpowiednie konto lub rachunek papierów wartościowych ma być prowadzone dla agenta do spraw zabezpieczeń w tym systemie – wskazujące podmiot mający pełnić funkcję agenta do spraw zabezpieczeń oraz, zgodnie z uchwałą Zarządu KDPW_CCP, odpowiedni identyfikator tego agenta lub wnioskodawcy w tym systemie, lub numer odpowiedniego konta lub rachunku papierów wartościowych prowadzonego na rzecz tego agenta lub wnioskodawcy w tym systemie,

b/ oświadczenie podmiotu wskazanego przez wnioskodawcę zgodnie z lit. a, który ma pełnić funkcje agenta do spraw zabezpieczeń, wyrażające zgodę, o której mowa w § 1 pkt 2a lit. a, na rzecz wnioskodawcy, chyba że z odrębnej umowy zawartej przez KDPW_CCP z tym podmiotem lub z podmiotem prowadzącym system depozytowy dla tych papierów wynika potwierdzenie pełnienia tej funkcji dla wnioskodawcy,

7/ jeżeli z właściwych przepisów prawa obowiązujących w państwie, w którym znajduje się siedziba wnioskodawcy, a w razie braku obowiązku jej ustanowienia – jego centrala, wynika, że rozporządzenia CRR nie stosuje się do jego działalności:

a/ oświadczenie tego wnioskodawcy wskazujące elementy określone w § 28 ust. 3 -4 oraz w § 29 ust. 2-4, które zgodnie z tymi przepisami kwalifikuje on do ustalenia wysokości kapitału podstawowego oraz funduszy będących równoważne funduszom własnym w rozumieniu rozporządzenia CRR, przy czym oświadczenie to powinno być poświadczane przez osobę, która posiada uprawnienia biegłego rewidenta uzyskane w państwie Unii Europejskiej, albo w państwie trzecim i podlega w tym państwie nadzorowi publicznemu, systemowi postępowania dyscyplinarnego i systemowi zapewnienia jakości, które zostały uznane za równoważne z wymaganiami przewidzianymi w przepisach prawa, o których mowa w § 8 ust. 1,

b/ wykaz informacji finansowych, o których mowa w § 32 ust. 3, w zakresie ustalonym zgodnie z ust. 2, jakie uczestnik ten jest obowiązany przekazywać do właściwych władz nadzorujących jego funkcjonowanie, oraz terminów, w jakich informacje te jest obowiązany przekazywać do tych władz, a w przypadku braku takiego obowiązku – oświadczenie, że zgodnie z właściwymi przepisami prawa obowiązującymi tego uczestnika nie jest on obowiązany do przekazywania określonych danych do tych władz.

3. Jeżeli wnioskodawca, który ubiega się o uzyskanie statusu uczestnika rozliczającego, zgodnie z obowiązującymi go właściwymi przepisami przekazał informacje finansowe, o których mowa w § 32 ust. 2 i 3, do właściwych władz nadzorujących jego funkcjonowanie, załącza ponadto do wniosku te informacje sporządzone za ostatni okres działalności poprzedzający dzień złożenia wniosku, wskazany, odpowiednio, w ust. 2 pkt 5 lit. a lub b. Z zastrzeżeniem ust. 4, wnioskodawca załącza informacje finansowe, o których mowa w zdaniu poprzedzającym, sporządzone w ujęciu jednostkowym, a jeżeli z właściwych przepisów prawa obowiązujących w państwie, w którym znajduje się jego siedziba albo, w razie braku obowiązku jej ustanowienia, jego centrala, wynika, że jest on obowiązany sporządzać i przekazywać właściwym władzom nadzorującym jego funkcjonowanie takie informacje w ujęciu skonsolidowanym – dodatkowo załącza te informacje sporządzone według tej zasady.

4. Jeżeli zgodnie z właściwymi przepisami rozporządzenia CRR właściwe władze nadzorujące funkcjonowanie wnioskodawcy odstąpiły od stosowania wymogów ostrożnościowych na zasadzie indywidualnej, wobec czego nie jest on obowiązany do przekazywania do tych władz sporządzonych w ujęciu jednostkowym informacji finansowych, o których mowa w § 32 ust. 2 i 3, załącza on do wniosku odpis dokumentu urzędowego potwierdzającego odstąpienie od stosowania wymogów ostrożnościowych na tej zasadzie. W tym przypadku wnioskodawca załącza informacje finansowe, które zostały przekazane w ujęciu skonsolidowanym właściwym władzom pełniącym nadzór skonsolidowany, którym jest objęty wnioskodawca, chyba że zgodnie z właściwymi przepisami prawa nie ma również obowiązku przekazywania tym władzom takich informacji, co potwierdza odpis dokumentu urzędowego załączony przez wnioskodawcę do wniosku.

5. Jeżeli wnioskodawca jest uczestnikiem odrębnego systemu rozliczeń prowadzonego przez KDPW_CCP dla transakcji zawieranych w obrocie zorganizowanym i ubiegając się o uczestnictwo w tym systemie złożył dokumenty, o których mowa w ust. 1 pkt 1-3 i 5-6, ust. 2 pkt 1-3, pkt 5 i 6 lit. a, pkt 7 oraz ust. 3-4, może zamiast tych dokumentów złożyć oświadczenie, w którym potwierdzi ich zastosowanie do uczestnictwa w systemie rozliczeń OTC, chyba że uległy one zmianie i KDPW_CCP nie został jeszcze o tym poinformowany.

6. Po zawarciu umowy o uczestnictwo oświadczenia, o których mowa w ust. 2 pkt 2, 3, 4 i 6, mogą zostać zmienione, jednakże zmiana taka staje się skuteczna względem KDPW_CCP najwcześniej drugiego dnia po dniu złożenia do KDPW_CCP oświadczenia w tej sprawie przez uczestnika, chyba że KDPW_CCP wyrazi zgodę na skrócenie tego terminu.”;

5/ w § 24 ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Uczestnik rozliczający, który uzyskał określony typ uczestnictwa, jest zobowiązany przed rozpoczęciem działalności w systemie rozliczeń OTC w ramach tego typu uczestnictwa do:

1/ dokonania wpłaty do funduszu zabezpieczającego OTC,

- 2/ wniesienia depozytu wstępnego w wysokości określonej przez Zarząd KDPW_CCP w drodze uchwały (wartość minimalna depozytu wstępnego),
- 3/ otwarcia w ramach określonego typu uczestnictwa właściwego konta rozliczeniowego w systemie rozliczeń OTC,
- 4/ dostarczenia pisemnego pełnomocnictwa dla KDPW_CCP, według wzoru określonego przez KDPW_CCP, do:
 - a/ zamykania na rachunek uczestnika pozycji w instrumentach pochodnych, w zakresie których uczestnik posiada status uczestnika rozliczającego, w przypadkach wskazanych w regulaminie,
 - b/ odbierania i składania w jego imieniu oświadczeń woli w sprawach dotyczących przeniesienia w ramach systemu zabezpieczania płynności rozliczania transakcji pozycji wynikających z transakcji zawartych przez podmiot występujący w typie uczestnictwa uczestnik nierozliczający, którego uczestnik reprezentuje w systemie rozliczeń, lub zawartych na rachunek tego podmiotu, wraz z zabezpieczeniem tych pozycji wniesionym tytułem właściwego depozytu zabezpieczającego, oraz wykonania czynności, o których mowa w §§ 110a-110c, w przypadkach wskazanych w regulaminie,
- 5/ dostarczenia pisemnego pełnomocnictwa dla KDPW_CCP, według wzoru określonego przez KDPW_CCP, do dokonywania w jego imieniu, w sposób określony w przepisach tytułu IVa regulaminu, zmiany lub uzupełnienia warunków transakcji, których jest stroną rozliczenia, w celu dostosowania jego transakcji do nadzwyczajnych okoliczności, o których mowa w § 44a, w szczególności w związku ze zmianą wskaźnika referencyjnego mającego wpływ na rozliczane transakcje,
- 6/ dostarczenia oświadczenia, według wzoru określonego przez KDPW_CCP, w którym uczestnik zobowiązuje się zapewnić przekazywanie raportów o transakcjach, albo wskazującego KDPW_CCP jako podmiot, który będzie przekazywać raporty o transakcjach do właściwego repozytorium transakcji, o ile z właściwych przepisów wynika obowiązek przekazywania tych raportów do repozytorium transakcji,
- 7/ przeprowadzenia testów potwierdzających gotowość uczestnika do rozpoczęcia działalności w systemie rozliczeń OTC, o których mowa w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC.”;

6/ § 27 otrzymuje brzmienie:

„§ 27

1. Uczestnik posiadający status uczestnika rozliczającego powinien spełniać warunki materialno-techniczne oraz warunki finansowe.
2. Spełnianie warunków finansowych polega na utrzymywaniu przez uczestnika odpowiedniej wielkości kapitału podstawowego oraz spełnianiu wymogów ostrożnościowych, o których mowa w § 28 i § 29, z zastrzeżeniem ust. 2a.
 - 2a. Spełnianie warunków finansowych przez uczestników, których podstawowym zadaniem jest podejmowanie działań na rzecz stabilności krajowego systemu finansowego na podstawie właściwych przepisów prawa, polega na utrzymywaniu przez nich odpowiedniej wielkości kapitału wymaganego zgodnie z tymi przepisami.
3. Spełnianie warunków materialno-technicznych polega na utrzymywaniu przez uczestnika wyposażenia technicznego i technologicznego umożliwiającego uczestnikowi zestawienie połączenia z systemem informatycznym używanym przez KDPW_CCP do prowadzenia systemu rozliczeń OTC

zapewniającego bezpieczne przesyłanie do tego systemu oraz odbieranie z niego dokumentów w formie elektronicznej.”;

7/ po § 36a dodaje się §§ 36b-36d w brzmieniu:

„§ 36b

Uczestnik rozliczający zapewnia w umowie zawieranej z podmiotem pełniącym wobec niego funkcję, odpowiednio, płatnika lub agenta do spraw rozrachunku, pełnienie tej funkcji zgodnie z przepisami regulaminu, a w szczególności jej pełnienie w czasie dostępności systemów, w ramach których funkcja ta jest realizowana.

§ 36c

1. Uczestnik powinien spełniać wymogi określone właściwymi przepisami prawa w zakresie dotyczącym przeciwdziałania praniu pieniędzy oraz finansowaniu terroryzmu w związku z podejmowanymi przez tego uczestnika stosunkami gospodarczymi.
2. W przypadku, jeżeli nastąpi zmiana stanu faktycznego lub prawnego mająca istotny wpływ na oświadczenie uczestnika zawarte w kwestionariuszu, o którym mowa w § 23 ust. 1 pkt 9, uczestnik ten jest zobowiązany niezwłocznie poinformować o tym KDPW_CCP, przekazując zaktualizowany kwestionariusz.

§ 36d

Każdy uczestnik jest zobowiązany niezwłocznie poinformować KDPW_CCP o:

- 1/ zastosowaniu wobec niego lub jego klienta, na rzecz którego jest stroną rozliczenia transakcji przyjętych do systemu rozliczeń, szczególnych środków ograniczających zgodnie z właściwymi przepisami prawa w związku z umieszczeniem na którejkolwiek z list sankcyjnych dotyczących zagrożeń dla międzynarodowego pokoju i bezpieczeństwa spowodowanych aktami terrorystycznymi, publikowanych na podstawie rezolucji Rady Bezpieczeństwa Organizacji Narodów Zjednoczonych, rozporządzeń Rady Unii Europejskiej oraz innych przepisów prawa obowiązujących wnioskodawcę, a także obowiązujących na terytorium Stanów Zjednoczonych Ameryki oraz Wielkiej Brytanii,
- 2/ wszczęciu wobec niego postępowania w związku ze świadczeniem usług finansowych, na podstawie którego mogą zostać zastosowane sankcje administracyjne za naruszenie obowiązujących go przepisów prawa oraz wydaniu decyzji w sprawie zastosowania wobec niego tych sankcji administracyjnych.”;

8/ w § 39 ust. 4 otrzymuje brzmienie:

„4. Z momentem nowacji umowa o uczestnictwo stanowi umowę ramową, o której mowa w art. 85 ust. 1 ustawy z dnia 28 lutego 2003 r. Prawo upadłościowe (tekst jednolity: Dz.U. z 2022 r., poz. 1520 z późn. zm.), dla transakcji przyjętych do rozliczenia, które powstały w wyniku nowacji, a transakcje te są wykonywane w ramach tej umowy.”;

9/ po § 44 dodaje się Tytuł IVa „Modyfikacja warunków transakcji w wyniku nadzwyczajnych okoliczności” oraz §§ 44a-44c w brzmieniu:

„§ 44a

KDPW_CCP jest uprawniony do dokonywania w imieniu uczestników rozliczających, zmiany lub uzupełnienia warunków rozliczanych transakcji zgodnie z przepisami niniejszego tytułu (dalej łącznie: „modyfikacja warunków transakcji”), w celu dostosowania rozliczanych transakcji do nadzwyczajnych okoliczności, jakie następują, powodując wpływ na rozliczane transakcje, a za które żadna ze stron odpowiedzialności nie ponosi, tj.:

- 1/ zmiana wskaźnika referencyjnego mającego wpływ na rozliczane transakcje,
- 2/ zaprzestanie opracowywania wskaźnika referencyjnego mającego wpływ na rozliczane transakcje,
- 3/ zawieszenie opracowywania wskaźnika referencyjnego mającego wpływ na rozliczane transakcji,
- 4/ inne nadzwyczajne okoliczności, które mają wpływ na rozliczane transakcje, z zastrzeżeniem ich określenia w regulaminie.

§ 44b

1. Z uwzględnieniem ust. 2-4, modyfikacja warunków transakcji, o której mowa w § 44a, dotyczy:
 - 1/ stopy referencyjnej ustalonej w tych warunkach,
 - 2/ innych warunków w związku ze zmianą stopy referencyjnej.
2. Z uwzględnieniem ust. 4, KDPW_CCP jest uprawniony, w ramach modyfikacji warunków transakcji, do ustanowienia i zarejestrowania w systemie rozliczeń OTC pozycji operacyjnych, których stroną rozliczenia są uczestnicy rozliczający, w celu odzwierciedlenia w tym systemie skutków modyfikacji warunków transakcji. Pozycje operacyjne:
 - 1/ stanowią treść transakcji, której warunki są modyfikowane, w związku z czym nie tworzą nowego stosunku prawnego,
 - 2/ mają wyłącznie charakter operacyjny i służą do odzwierciedlenia w systemie rozliczeń OTC skutków modyfikacji warunków transakcji,
 - 3/ w związku z powyższym nie powodują zwiększenia wartości nominalnej transakcji, której warunki są modyfikowane.
3. Po dokonaniu modyfikacji warunków transakcji strona rozliczenia jest, odpowiednio, zobowiązana do zapłaty albo uprawniona do otrzymania świadczenia wynikającego ze zmiany wyceny transakcji na skutek tej modyfikacji.
4. Szczegółowe modyfikacje warunków transakcji, w tym sposób ustalenia wszelkich płatności pomiędzy stronami transakcji, sposób ustanowienia i zarejestrowania pozycji operacyjnych, o których mowa w ust. 2, są określone w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC.

§ 44c

1. W celu dokonania modyfikacji warunków transakcji, KDPW_CCP przekazuje uczestnikom rozliczającym oświadczenie, w którym określa w szczególności:
 - 1/ rodzaj transakcji, których dotyczy modyfikacja warunków transakcji,
 - 2/ stopę referencyjną podlegającą zmianie oraz termin lub terminy modyfikacji warunków transakcji zgodnie ze Szczegółowymi Zasadami Systemu Rozliczeń OTC.
2. Modyfikacja warunków transakcji następuje w terminie określonym w oświadczeniu KDPW_CCP, o którym mowa w ust. 1.

3. Oświadczenie KDPW_CCP, o którym mowa w ust. 1, jest przekazywane do uczestników rozliczających co najmniej dwa tygodnie przed terminem modyfikacji warunków transakcji.
4. Oświadczenie KDPW_CCP, o którym mowa w ust. 1, stanowi wyrażenie zgody na modyfikację warunków transakcji, przy czym KDPW_CCP składa je w imieniu własnym oraz w imieniu uczestników rozliczających będących drugą stroną rozliczenia tych transakcji (działając na podstawie udzielonego przez uczestników rozliczających pełnomocnictwa).
5. Z chwilą złożenia przez KDPW_CCP oświadczenia, o którym mowa w ust. 1, KDPW_CCP staje się uprawniony do dokonania w systemie rozliczeń OTC wszelkich czynności mających na celu dokonanie, w terminie określonym w tym oświadczeniu, modyfikacji warunków transakcji.
6. KDPW_CCP jest uprawniony do złożenia więcej niż jednego oświadczenia, o którym mowa w ust. 1, w zakresie modyfikowanych warunków transakcji.”;

10/ w § 71 ust. 2 otrzymuje brzmienie:

„2. Systemem zabezpieczeń płynności rozliczania transakcji organizowanym przez KDPW_CCP objęte są również:

- a/ transakcje zawarte przez KDPW_CCP w ramach tego systemu i zgodnie z przepisami niniejszego działu,
- b/ stosunki prawne, o których mowa w § 41 ust. 1 pkt 2.”;

11/ § 73 otrzymuje brzmienie:

„§ 73

W ramach systemu zabezpieczania płynności dokonywanych rozliczeń transakcji KDPW_CCP:

- 1/ gromadzi i zarządza środkami stanowiącymi depozyty zabezpieczające,
- 2/ gromadzi i zarządza środkami tworzącymi fundusz zabezpieczający OTC,
- 2a/ ustala wartość depozytu zmiennego oraz wartość pożytków od tego depozytu,
- 3/ monitoruje ryzyko wynikające z transakcji przyjmowanych do rozliczenia i podejmuje działania mające na celu zmniejszenie tego ryzyka,
- 4/ prowadzi obsługę zamykania pozycji na żądanie w zakresie określonym w niniejszym regulaminie i Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC,
- 5/ przeprowadza operację aukcji w zakresie określonym w niniejszym regulaminie i Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC,
- 6/ podejmuje działania mające na celu wykonanie świadczeń wynikających z rozliczenia transakcji w razie:
 - a/ zawieszenia rozrachunku transakcji,
 - b/ niezrealizowania w terminie ustalonym przez strony transakcji świadczeń pieniężnych wynikających z jej rozliczenia,
 - c/ wystąpienia przypadku naruszenia uzasadniającego natychmiastowe rozwiązanie umowy.”;

12/ w § 74a ust. 2 otrzymuje brzmienie:

„2. Przychody osiągnięte z tytułu zarządzania środkami pieniężnymi wniesionymi przez uczestników rozliczających do systemu zabezpieczania płynności rozliczania transakcji, z wyłączeniem przychodów osiągniętych z tytułu zarządzania środkami pieniężnymi wniesionymi w walucie euro, są przekazywane

uczestnikom rozliczającym kwartalnie, o ile Zarząd KDPW_CCP nie określi innego terminu w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC, po pomniejszeniu ich o należne podatki. Jeżeli jednak uczestnik opóźnia się z wykonaniem wobec KDPW_CCP jakiegokolwiek zobowiązania wynikającego z jego uczestnictwa w systemie rozliczeń OTC lub w odrębnym systemie rozliczeń prowadzonym przez KDPW_CCP dla transakcji zawieranych w obrocie zorganizowanym, KDPW_CCP może, zamiast przekazywać je uczestnikowi, zarachować je na poczet tych zobowiązań.”;

13/ w § 76 ust. 2 otrzymuje brzmienie:

„2. Uczestnik rozliczający jest odpowiedzialny za zawieszenie rozrachunku transakcji, której jest stroną rozliczenia, z powodu okoliczności, jakie wystąpiły po jego stronie albo po stronie jego agenta do spraw rozrachunku lub jego płatnika, za pomocą których dokonuje rozrachunku transakcji lub którym powierza wykonanie tego rozrachunku, jeżeli z powodu tych okoliczności podmiot prowadzący system rozrachunku podjął działanie, o którym mowa w art. 45f ust. 1 ustawy. W momencie otrzymania z systemu rozrachunku informacji, z której wynika, że zobowiązania te nie zostały wykonane w terminie i podmiot prowadzący ten system podjął działanie, o którym mowa w art. 45f ust. 1 ustawy, KDPW_CCP stwierdza zawieszenie rozrachunku transakcji z powodu okoliczności, za które uczestnik ten ponosi odpowiedzialność. Uczestnik ten jest zobowiązany podjąć niezwłocznie czynności, które spowodują jak najszybszą likwidację zawieszenia rozrachunku transakcji.”;

14/ § 78a otrzymuje brzmienie:

„§ 78a

1. KDPW_CCP zobowiązuje się do pokrycia strat na wypadek niewykonania zobowiązań wynikających z rozliczanych przez KDPW_CCP transakcji, do których wykonania jest zobowiązany kosztem majątku własnego:

1/ przed wykorzystaniem środków wniesionych do funduszu zabezpieczającego OTC, z wyłączeniem wpłaty wniesionej przez uczestnika, po stronie którego wystąpił przypadek naruszenia - środkami stanowiącymi zasób celowy I, z uwzględnieniem alokacji zgodnie z ust. 3,

2/ po wykorzystaniu wszystkich środków wniesionych odpowiednio, do funduszu rozliczeniowego albo do właściwego funduszu zabezpieczającego – środkami stanowiącymi zasób celowy II, z uwzględnieniem alokacji zgodnie z ust. 3.

2. KDPW_CCP przeznacza na zasób celowy I środki własne w wysokości odpowiadającej co najmniej 25% wymogu kapitałowego dla KDPW_CCP, z uwzględnieniem alokacji zgodnie z ust. 3.

2a. KDPW_CCP przeznacza na zasób celowy II środki własne w wysokości odpowiadającej 25% wymogu kapitałowego dla KDPW_CCP, z uwzględnieniem alokacji zgodnie z ust. 3.

3. Wysokość środków, o których mowa, odpowiednio, w ust. 2 oraz ust. 2a, oblicza się z uwzględnieniem alokacji tych środków w stosunku do funduszu zabezpieczającego OTC, innych funduszy zabezpieczających i funduszu rozliczeniowego, zarządzanych przez KDPW_CCP w ramach innego systemu rozliczeń, proporcjonalnie do wartości każdego z tych funduszy. KDPW_CCP informuje na swojej stronie internetowej o zasadach tej alokacji.

4. W przypadku wykorzystania zgodnie z postanowieniami regulaminu środków stanowiących, odpowiednio, zasób celowy I lub zasób celowy II, KDPW_CCP niezwłocznie podejmuje działania mające

na celu uzupełnienie tego zasobu celowego do wysokości, o której mowa, odpowiednio, w ust. 2 lub ust. 2a, w terminie jednego miesiąca od dnia, w którym środki te zostały wykorzystane.

5. KDPW_CCP informuje uczestników posiadających status uczestnika rozliczającego o:

1/ aktualnej wysokości środków stanowiących zasób celowy I oraz zasób celowy II, a także o wyniku alokacji tych środków - na swojej stronie internetowej lub za pośrednictwem systemu SWI lub systemu GUI;

2/ wysokości wszystkich środków własnych KDPW_CCP oraz o wysokości wymogu kapitałowego dla KDPW_CCP – niezwłocznie po otrzymaniu pisemnego żądania uczestnika posiadającego status uczestnika rozliczającego.”;

15/ w § 79:

a/ ust. 5 pkt 2 otrzymuje brzmienie:

„2/ stanowi zabezpieczenie finansowe, o którym mowa w art. 1 w związku z art. 5 ust. 1 pkt 1 ustawy z dnia 2 kwietnia 2004 r. o niektórych zabezpieczeniach finansowych (tekst jednolity: Dz.U. z 2022 r., poz. 133), z zastrzeżeniem § 86 ust. 2.”;

b/ po ust. 9 dodaje się ust. 9a w brzmieniu:

„9a. Nadwyżki wniesione przez uczestnika rozliczającego tytułem danego depozytu zabezpieczającego na właściwy rachunek prowadzony na rzecz KDPW_CCP ponad wymaganą wysokość depozytu zabezpieczającego, stanowią również zabezpieczenie finansowe wniesione tytułem tego depozytu.”;

16/ w § 81 ust. 4 otrzymuje brzmienie:

„4. Wartość papierów wartościowych, które zostały wyemitowane przez uczestnika rozliczającego lub przez podmiot wchodzący w skład tej samej grupy kapitałowej, w rozumieniu art. 3 ust. 1 pkt 44 ustawy z dnia 29 września 1994 o rachunkowości (tekst jednolity: Dz.U. z 2023 r., poz. 120 z późn. zm.), co uczestnik, a także w zakresie których udzielił on lub ten podmiot gwarancji lub poręczenia wykonania zobowiązań wynikających z tych papierów, nie jest w jakimkolwiek zakresie uwzględniana przy ustalaniu wartości złożonych przez tego uczestnika depozytów zabezpieczających. Jeżeli w wyniku połączenia, podziału lub przejęcia uczestnika lub innego podmiotu, który wyemitował papiery wartościowe wniesione przez tego uczestnika tytułem depozytów zabezpieczających, a także nabycia znacznego pakietu akcji lub udziałów uczestnika lub tego podmiotu albo innego zdarzenia następuje skutek, w wyniku którego papiery wartościowe stają się papierami wyemitowanymi przez uczestnika, który je wniósł tytułem depozytów zabezpieczających, bądź przez podmiot wchodzący w skład tej samej grupy kapitałowej, w rozumieniu art. 3 ust. 1 pkt 44 ustawy z dnia 29 września 1994 r. o rachunkowości, co uczestnik, wartość tych papierów przestaje być w jakimkolwiek zakresie uwzględniana przy ustalaniu wartości złożonych depozytów zabezpieczających począwszy od drugiego dnia, w którym KDPW_CCP dowiedział się o tym.”;

17/ tytuł Oddziału 5 Działu IV otrzymuje brzmienie:

„Oddział 5 Operacja aukcji w przypadku rozwiązania przez KDPW_CCP umowy o uczestnictwo w trybie natychmiastowym”;

18/ §§ 96-99a otrzymują brzmienie:

„§ 96

1. Operacja aukcji jest organizowana w przypadku rozwiązania w trybie natychmiastowym umowy o uczestnictwo zawartej z uczestnikiem naruszającym, w celu zabezpieczenia realizacji świadczeń pieniężnych wynikających z rozliczeń transakcji dotkniętych oraz zamknięcia pozycji uczestnika naruszającego w związku z rozwiązaniem z nim umowy o uczestnictwo w trybie natychmiastowym. Uczestnictwo w operacji aukcji jest obowiązkowe dla wszystkich uczestników rozliczających, którzy otrzymali propozycję otwarcia pozycji, o której mowa w § 97 ust. 1.
2. Operacja aukcji polega na zawarciu przez KDPW_CCP transakcji, odpowiadającej pozycji lub pozycjom uczestnika naruszającego, które mają być zamykane. Zamykanie pozycji następuje zgodnie z § 104 ust. 3.
3. Operacja, o której mowa w ust. 1, jest inicjowana przez KDPW_CCP w przypadku rozwiązania transakcji powstałych w wyniku nowacji pomiędzy KDPW_CCP a uczestnikiem naruszającym i zamknięcia pozycji rejestrowanych na kontach rozliczeniowych prowadzonych dla tego uczestnika.
4. KDPW_CCP przeprowadza operację, o której mowa w ust. 1, z należytą starannością uzasadnioną warunkami rynkowymi występującymi w dniu jej przeprowadzenia.

§ 97

1. KDPW_CCP przeprowadza operację aukcji w zakresie wskazanych przez KDPW_CCP pozycji, przesyłając do pozostałych uczestników rozliczających dyspozycję z propozycją otwarcia pozycji, która ma na celu zabezpieczenie realizacji świadczeń pieniężnych wynikających z rozliczeń transakcji dotkniętych lub zamknięcie pozycji uczestnika naruszającego. KDPW_CCP jest uprawniony do ograniczenia liczby uczestników rozliczających, do których przesyła propozycję otwarcia pozycji na zasadach określonych w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC.
2. Każdy uczestnik rozliczający, który otrzymał propozycję otwarcia pozycji, jest zobowiązany, na zasadach określonych w regulaminie oraz w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC, złożyć do KDPW_CCP ofertę zawarcia transakcji. Złożenie przez uczestnika rozliczającego oferty zawarcia transakcji oznacza jednocześnie wyrażenie przez niego zgody na skierowanie transakcji do rozliczenia w systemie rozliczeń OTC oraz na skutki, o których mowa w ust. 3 pkt 1.
3. Jeżeli KDPW_CCP akceptuje warunki otrzymanej oferty zawarcia transakcji:
 - 1/ dostarcza do uczestnika rozliczającego potwierdzenie zawarcia transakcji (transakcja zostaje zawarta z momentem dostarczenia uczestnikowi rozliczającemu tego potwierdzenia), a następnie
 - 2/ rejestruje tę transakcję w systemie rozliczeń OTC.

§ 98

1. Zarząd KDPW_CCP określa w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC informacje, które powinny zostać zawarte w propozycji otwarcia pozycji oraz w ofercie zawarcia transakcji, z zastrzeżeniem, że:
 - 1/ cena oferty zawarcia transakcji wynika z treści tej oferty, ustalonej według zasad określonych w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC,
 - 2/ termin rozliczenia świadczenia pieniężnego wynikającego z rozliczenia transakcji nie może

przypadać po upływie terminu określonego w Szczegółowych Zasadach Systemu Rozliczeń OTC, liczonego od momentu zawarcia tej transakcji,

3/ instrument pochodny albo papier wartościowych, będący przedmiotem transakcji odpowiada rodzajowi i parametrom, odpowiednio, instrumentu pochodnego albo papieru wartościowego, będącego przedmiotem transakcji dotkniętej.

2. Szczegółowe zasady i tryb dostarczania propozycji otwarcia pozycji oraz oferty zawarcia transakcji określają Szczegółowe Zasady Systemu Rozliczeń OTC.

§ 99

KDPW_CCP jest uprawniony do wstrzymania realizacji czynności w ramach operacji aukcji bez podania przyczyn.

§ 99a

1. Uczestnik naruszający jest zobowiązany do zwrotu kosztów przeprowadzenia operacji aukcji, które zostały poniesione na rzecz osób trzecich (prowizje, opłaty transakcyjne i bankowe), w związku z działaniami podjętymi zgodnie z regulaminem oraz Szczegółowymi Zasadami Systemu Rozliczeń OTC.

2. KDPW_CCP jest zobowiązany po wykonaniu operacji aukcji, udokumentować, na pisemne żądanie uczestnika naruszającego, wszystkie poniesione koszty, o których mowa w ust. 1.

3. Koszty przeprowadzenia operacji aukcji są pokrywane z depozytów zabezpieczających wniesionych przez uczestnika naruszającego, a gdyby środki te okazały się niewystarczające – ze środków funduszu zabezpieczającego OTC oraz z majątku własnego KDPW_CCP, w wysokości oraz kolejności określonej w § 101 ust. 2 i § 102 ust. 2, z uwzględnieniem § 107a.”;

19/ w § 101 ust. 2 otrzymuje brzmienie:

„2. Z zastrzeżeniem ust. 3, ewentualne różnice cen papierów wartościowych pomiędzy transakcją zbycia dokonywanego zgodnie z ust. 1, a transakcją, której rozrachunek został zawieszony, z uwzględnieniem kosztów transakcyjnych, przysługują KDPW_CCP, jeżeli są dodatnie, jeżeli zaś są ujemne podlegają pokryciu z depozytów zabezpieczających wniesionych przez uczestnika naruszającego, a po wykorzystaniu tych środków, w następującej kolejności:

1/ z wpłaty do funduszu zabezpieczającego OTC wniesionej przez tego uczestnika,

2/ z zasobu celowego I, w wysokości obliczonej zgodnie z § 78a ust. 2 i 3,

3/ z pozostałych środków funduszu zabezpieczającego OTC, z uwzględnieniem § 107a,

4/ zasobu celowego II, w wysokości obliczonej zgodnie z § 78a ust. 2a i 3.”;

20/ w § 102 ust. 2 otrzymuje brzmienie:

„2. Jeżeli depozyty zabezpieczające wniesione przez uczestnika naruszającego, o którym mowa w ust. 1, okażą się niewystarczające, jego zobowiązania pieniężne wykonywane są w następującej kolejności:

1/ z wpłaty do funduszu zabezpieczającego OTC wniesionej przez tego uczestnika,

2/ z zasobu celowego I, w wysokości obliczonej zgodnie z § 78a ust. 2 i 3,

3/ z pozostałych środków funduszu zabezpieczającego OTC, z uwzględnieniem § 107a,

4/ zasobu celowego II, w wysokości obliczonej zgodnie z § 78a ust. 2a i 3.”;

21/ w § 104 ust. 2 otrzymuje brzmienie:

„2. Zamknięcie pozycji, o którym mowa w ust. 1, następuje w ramach operacji aukcji.”;

22/ po § 107 dodaje się § 107a w brzmieniu:

„§ 107a

KDPW_CCP wykorzystuje środki wniesione do funduszu zabezpieczającego OTC zgodnie z przepisami niniejszego działu w celu doprowadzenia do wykonania zobowiązania wynikającego z rozliczenia transakcji objętej systemem zabezpieczania płynności rozliczania transakcji, przy czym alokacja tych środków na poczet wykonania tego zobowiązania następuje z uwzględnieniem zaangażowania uczestników w przeprowadzonej przez KDPW_CCP operacji aukcji, tj.:

a/ w pierwszej kolejności są wykorzystywane wpłaty wniesione przez tych uczestników, którzy nie uczestniczyli w aukcji lub nie złożyli oferty wymaganej zgodnie z przepisami Szczegółowych Zasad Systemu Rozliczeń OTC,

b/ w drugiej kolejności są wykorzystywane wpłaty wniesione przez tych uczestników, których oferty nie zostały zaakceptowane przez KDPW_CCP, za wyjątkiem tych ofert, których wysokość odpowiadała wysokości oferty, która została zaakceptowana przez KDPW_CCP,

c/ w ostatniej kolejności są wykorzystywane wpłaty wniesione przez tych uczestników, których oferty zostały zaakceptowane przez KDPW_CCP lub odpowiadały warunkom ofert zaakceptowanych przez KDPW_CCP, lecz zostały odrzucone z przyczyn niezależnych od uczestników rozliczających, którzy je złożyli.”;

23/ § 108a otrzymuje brzmienie:

„§ 108a

1. Jeżeli w wyniku działań KDPW_CCP realizowanych w celu doprowadzenia do wykonania zobowiązania wynikającego z rozliczenia transakcji przyjętej do systemu rozliczeń OTC lub do odrębnego systemu rozliczeń prowadzonego przez KDPW_CCP dla transakcji zawieranych w obrocie zorganizowanym, wysokość środków KDPW_CCP spadnie do 110% ustalonej wysokości wymogu kapitałowego dla KDPW_CCP, KDPW_CCP informuje o tym niezwłocznie uczestników rozliczających. W takim przypadku KDPW_CCP, przed wykorzystaniem pozostałych środków własnych, wzywa tych uczestników do wniesienia do funduszu zabezpieczającego OTC wpłat dodatkowych do tego funduszu, nie wyższych niż 100% maksymalnej wysokości dotychczasowych wpłat, jaka wynika z ostatniej ich aktualizacji, o ile zobowiązanie wynikające z transakcji, które powinno być wykonane, jest zabezpieczone tym funduszem.

2. Niezwłocznie po wniesieniu wpłat dodatkowych, o których mowa w ust. 1, do funduszu zabezpieczającego OTC, KDPW_CCP wykorzystuje te środki w celu doprowadzenia do wykonania zobowiązania wynikającego z rozliczenia transakcji objętej systemem zabezpieczania płynności rozliczania transakcji, z uwzględnieniem § 107a.

3. Jeżeli wysokość środków własnych KDPW_CCP spadnie poniżej 110% ustalonej wysokości wymogu kapitałowego dla KDPW_CCP, Zarząd KDPW_CCP jest zobowiązany do niezwłocznego poinformowania

uczestników posiadających status uczestnika rozliczającego:

- 1/ o wysokości środków własnych KDPW_CCP oraz
- 2/ o fakcie przywrócenia stanu, w którym wysokość środków własnych KDPW_CCP osiągnie poziom 110% ustalonej wysokości wymogu kapitałowego dla KDPW_CCP.”;

24/ po § 108a dodaje się §§ 108b-108c w brzmieniu:

„§ 108b

1. W przypadku, jeżeli w następstwie okoliczności, za które KDPW_CCP nie ponosi odpowiedzialności, działania realizowane przez KDPW_CCP, po stwierdzeniu przypadku naruszenia w stosunku do uczestnika naruszającego, nie mogą doprowadzić do wykonania w całości zobowiązania wynikającego z rozliczenia transakcji przyjętej do systemu rozliczeń OTC, pomimo:

1/ wykorzystania środków w kolejności oraz w wysokości określonej w § 78a ust. 1-3 oraz § 102 ust. 2 - KDPW_CCP może zwrócić się do pozostałych uczestników rozliczających o obniżenie wartości depozytu zmiennego lub kwoty rozrachunku, jakie przysługują lub będą przysługiwać tym uczestnikom rozliczającym,

2/ przeprowadzenia operacji aukcji po raz trzeci - KDPW_CCP może zwrócić się do pozostałych uczestników rozliczających o rozwiązanie w całości lub w części rozliczanych transakcji, których są drugą stroną rozliczenia.

2. Zmiany warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 i 2, obejmują wyłącznie pozycje zarejestrowane na kontach własnych uczestników.

3. Przed zwróceniem się do uczestników rozliczających o zmianę warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 i 2, KDPW_CCP informuje uczestników rozliczających, że podjęte dotychczas działania nie doprowadziły do wykonania zobowiązania wynikającego z rozliczenia transakcji przyjętej do systemu rozliczeń OTC i w związku z tym we wskazanym terminie organizuje operację aukcji po raz ostatni.

4. W celu zwrócenia się do uczestników rozliczających o zmianę warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 lub 2, KDPW_CCP przesyła do nich propozycję, w której określa w szczególności:

1/ pozycje, które zostały objęte propozycją tej zmiany warunków,

2/ termin, w którym uczestnicy rozliczający zobowiązani są złożyć oświadczenie, czy wrażliwą zgodę na zmianę tych warunków, czy nie zgadzają się na tę zmianę warunków,

3/ termin, w którym ma nastąpić zmiana warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 lub 2,

4/ w przypadku zmiany warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1:

a/ wskaźnik podziału redukcji wartości, ustalony zgodnie z przepisami Szczegółowych Zasad Systemu Rozliczeń OTC,

b/ okres, w którym zmiana warunków transakcji ma obowiązywać,

5/ w przypadku zmiany warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 2 – limit, do którego pozycje mogą zostać zamknięte, ustalony zgodnie z przepisami Szczegółowych Zasad Systemu Rozliczeń OTC.

5. Zmiana warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 i 2, wymaga zgody uczestników rozliczających będących stroną rozliczenia co najmniej 2/3 wartości pozycji zarejestrowanych w systemie rozliczeń OTC, które zostały objęte tą zmianą, przy czym:

1/ uczestnicy rozliczający zobowiązani są do złożenia oświadczenia o wyrażeniu albo niewyrażeniu tej

zgody,

2/ uczestnicy rozliczający, którzy nie złożyli w terminie oświadczenia o wyrażeniu albo niewyrażeniu tej zgody nie są uwzględniani przy obliczeniu większości kwalifikowanej, o której mowa powyżej, wymagającej tej zgody (tj. wartość pozycji, których są stroną rozliczenia, pomija się przy tym obliczeniu).

6. Wyrażenie zgody, o której mowa w ust. 5, oznacza, że:

1/ w przypadku zmiany warunków, o której mowa w ust. 1 pkt 1 - KDPW_CCP nie jest zobowiązany do wypłaty, odpowiednio, depozytu zmiennego lub kwoty rozrachunku z tytułu bieżących rozliczeń transakcji, w wysokości przewyższającej ustalony wskaźnik podziału redukcji wartości, zaś uczestnik rozliczający pozostaje zobowiązany w pełnej wysokości wobec KDPW_CCP do wypłaty tych świadczeń, obliczonych w tym okresie z tytułu bieżących rozliczeń,

2/ w przypadku zmiany warunków, o której mowa w ust. 1 pkt 2 – strony rozliczenia nie są zobowiązane do wykonania rozliczanej transakcji w wysokości określonej w uzgodnionym limicie.

7. Zmiana warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 i 2, następuje w terminie określonym w propozycji, o której mowa w ust. 4, pod warunkiem wyrażenia przez uczestników rozliczających zgody zgodnie z ust. 5. KDPW_CCP niezwłocznie informuje uczestników rozliczających o:

1/ liczbie uczestników rozliczających, którzy:

a/ złożyli oświadczenia w sprawie zmiany warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 lub 2,

b/ wyrazili zgodę na zmianę tych warunków,

c/ nie wyrazili zgody na zmianę tych warunków,

2/ dokonaniu albo niedokonaniu zmiany warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 lub 2, a w przypadku zmiany tych warunków – o potwierdzeniu terminu, w którym następuje zmiana tych warunków.

8. Szczegółowe Zasady Systemu Rozliczeń OTC określają szczegółowe zasady i tryb postępowania w sprawie zmiany warunków, o których mowa w ust. 1 pkt 1 i 2, w tym dotyczące składania propozycji zmiany tych warunków oraz wyrażenia przez uczestników rozliczających zgody, o której mowa w ust. 5.

§ 108c

1. W przypadku stwierdzenia przez KDPW_CCP przypadku naruszenia w stosunku do uczestnika naruszającego i rozpoczęcia działań, o których mowa w niniejszym dziale, KDPW_CCP jest uprawniony do wstrzymania wypłat na rzecz uczestników rozliczających:

1/ wszystkich środków z systemu zabezpieczania płynności rozliczania transakcji, oraz

2/ wartości depozytu zmiennego lub kwoty rozrachunku, jakie przysługują lub będą przysługiwać tym uczestnikom rozliczającym,

do czasu zakończenia tych działań i zamknięcia pozycji uczestnika naruszającego, ale nie później niż przez okres 10 dni roboczych licząc od dnia stwierdzenia tego przypadku naruszenia.

2. KDPW_CCP jest zobowiązany do:

1/ poinformowania wszystkich uczestników rozliczających o wstrzymaniu wypłat środków, o których mowa w ust. 1,

2/ bieżącego wyliczania wartości depozytu zmiennego lub kwoty rozrachunku, jakie przysługują lub będą przysługiwać tym uczestnikom rozliczającym, w okresie, w którym wypłata tych korzyści,

3/ po zakończeniu okresu, w którym wypłata środków, o których mowa w ust. 1, została wstrzymana, dokonania na rzecz uczestników rozliczających płatności tych środków, przy czym wyliczone każdego dnia wartości depozytu zmiennego lub kwoty rozrachunku zostają skompensowane do jednej należności pieniężnej.”;

25/ w § 109 ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Na wypadek, gdyby działania KDPW_CCP, o których mowa w postanowieniach poprzedzających niniejszego oddziału, nie mogły doprowadzić do wykonania zobowiązania wynikającego z rozliczenia, odpowiednio, transakcji repo albo transakcji sprzedaży, której rozrachunek został zawieszony, albo transakcji pochodnej, KDPW_CCP zobowiązuje się wykonać to zobowiązanie kosztem majątku własnego w takim zakresie, w jakim pozostało ono niewykonane pomimo tych działań, z zastrzeżeniem § 108a i 108b.”;

26/ § 111 otrzymuje brzmienie:

„§ 111

1. Rozwiązanie umowy o uczestnictwo może nastąpić:

- 1/ na podstawie oświadczenia uczestnika rozliczającego z upływem dwóch tygodni od dnia jego złożenia, z zastrzeżeniem ust. 2-6,
- 2/ za porozumieniem stron,
- 3/ na podstawie oświadczenia KDPW_CCP w trybie natychmiastowego rozwiązania umowy, w razie wystąpienia przypadku naruszenia,
- 4/ z zastrzeżeniem ust. 4-6, na podstawie oświadczenia uczestnika rozliczającego w trybie natychmiastowego rozwiązania umowy, w przypadku wystąpienia któregokolwiek z następujących zdarzeń:

a/ KDPW_CCP nie dokonał zgodnie z regulaminem płatności tytułem:

- wykonania świadczenia rozliczeniowego, ustalonego w wyniku rozliczenia transakcji w systemie rozliczeń OTC, albo
- wykonania świadczenia zastępczego w celu wygaśnięcia zobowiązania wynikającego z transakcji rozliczanej w systemie rozliczeń OTC,

w okresie 45 dni kalendarzowych licząc od dnia, w którym KDPW_CCP stał się zobowiązany do wykonania tego świadczenia na rzecz uczestnika rozliczającego dotkniętego naruszeniem, wskazanego w, odpowiednio, § 102 ust. 1, § 103 ust. 1 oraz § 106 ust. 1, przy czym zobowiązanie do wykonania tej płatności nie wygasło, nie zostało rozwiązane za zgodą uczestnika rozliczającego będącego wierzycielem z tego tytułu, nie został zmieniony termin wykonania tego zobowiązania za zgodą tego uczestnika, nie zostało ono umorzone ani nie uległo przedawnieniu,

b/ w stosunku do KDPW_CCP została ogłoszona upadłość lub został oddalony wniosek o ogłoszenie upadłości ze względu na to, że majątek KDPW_CCP nie wystarcza na zaspokojenie kosztów postępowania lub wystarcza jedynie na zaspokojenie tych kosztów,

c/ Zarząd lub likwidator KDPW_CCP złożył wniosek o ogłoszenie upadłości KDPW_CCP,

d/ podmiot będący wierzycielem KDPW_CCP złożył wniosek o ogłoszenie upadłości KDPW_CCP, a jednocześnie została spełniona dodatkowo przynajmniej jedna z następujących przesłanek: wniosek

ten nie został wycofany, oddalony, zwrócony albo odrzucony w terminie 60 dni kalendarzowych od daty jego złożenia z powodów innych, niż wskazane w art. 13 ustawy z dnia 28 lutego 2003 r. Prawo upadłościowe,

e/ KDPW_CCP została postawiona w stan likwidacji, a jednocześnie – w przypadku, gdy rozwiązanie KDPW_CCP nie następuje na podstawie prawomocnego orzeczenia sądowego - w terminie 30 dni kalendarzowych od dnia otwarcia likwidacji nie została podjęta uchwała Walnego Zgromadzenia KDPW_CCP zapobiegająca rozwiązaniu, o której mowa w art. 460 § 1 ustawy z dnia 15 września 2000 r. – Kodeks spółek handlowych (tekst jednolity: Dz.U. z 2022 r., poz. 1467 z późn. zm.),

f/ Komisja Nadzoru Finansowego podjęła decyzję o cofnięciu zezwolenia udzielonego KDPW_CCP na świadczenie usług rozliczeniowych jako CCP i upłynął termin na wniesienie środków zaskarżenia lub środki te zostały wyczerpane.

2. Jeżeli na kontach rozliczeniowych prowadzonych dla uczestnika rozliczającego są zarejestrowane pozycje, stany wynikające z kompensacji pozycji, bądź uczestnik ten jest zobowiązany do wykonania świadczenia z tytułu uczestnictwa w systemie rozliczeń OTC, rozwiązanie umowy o uczestnictwo w przypadku, o którym mowa w ust. 1 pkt 1, może nastąpić pod warunkiem wyrejestrowania tych pozycji z systemu rozliczeń oraz wykonania wszystkich zobowiązań z tytułu uczestnictwa w tym systemie.

3. Rozwiązanie umowy o uczestnictwo w przypadku, o którym mowa w ust. 1 pkt 1, następuje pod warunkiem, że przed upływem dwóch tygodni od złożenia wniosku przez uczestnika KDPW_CCP nie stwierdzi przypadku naruszenia w stosunku do któregośkolwiek z uczestników posiadających status uczestnika rozliczającego. Jeżeli KDPW_CCP stwierdzi przypadek naruszenia w stosunku do którejkolwiek z uczestników posiadających status uczestnika rozliczającego, rozwiązanie umowy o uczestnictwo na podstawie złożonego przez uczestnika wniosku, o którym mowa w ust. 1 pkt 1, następuje po zakończeniu przez KDPW_CCP działań, o których mowa w § 100 i nast. oraz po wykonaniu przez tego uczestnika wszystkich obowiązków wynikających z uczestnictwa w systemie rozliczeń, w tym obowiązku wniesienia wymaganej wpłaty do funduszu zabezpieczającego OTC.

4. Uczestnik rozliczający, wobec którego KDPW_CCP stwierdził przypadek naruszenia i rozpoczął którejkolwiek z działań określonych w § 113 ust. 1 przed wystąpieniem którejkolwiek z okoliczności uzasadniającej rozwiązanie umowy o uczestnictwo, o której mowa w ust. 1 pkt 4, nie jest uprawniony do rozwiązania umowy o uczestnictwo ze skutkiem natychmiastowym, chyba że zgodnie z otrzymanym wezwaniem, o którym mowa w § 113 ust. 3, wykonał wszystkie swoje zobowiązania wynikające z transakcji przyjętych do rozliczenia w systemie rozliczeń OTC, których uczestnik ten jest stroną rozliczenia, oraz wynikające z tytułu jego uczestnictwa w systemie zabezpieczania płynności rozliczenia transakcji.

5. Jeżeli KDPW_CCP uruchomił plan naprawy, o którym mowa w art. 9 ust. 1 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2021/23 z dnia 16 grudnia 2020 r. w sprawie ram na potrzeby prowadzenia działań naprawczych oraz restrukturyzacji i uporządkowanej likwidacji w odniesieniu do kontrahentów centralnych oraz zmieniające rozporządzenia (UE) nr 1095/2010, (UE) nr 648/2012, (UE) nr 600/2014, (UE) nr 806/2014 i (UE) 2015/2365 oraz dyrektywy 2002/47/WE, 2004/25/WE, 2007/36/WE, 2014/59/UE i (UE) 2017/1132:

1/ informuje o tym uczestników rozliczających,

2/ może zaproponować uczestnikowi rozliczającemu będącemu stroną zobowiązania, w zakresie którego KDPW_CCP nie dokonał zgodnie z regulaminem płatności, inny sposób wykonania tego zobowiązania, w szczególności odroczenie terminu płatności, lub zmianę treści tego zobowiązania. W przypadku, jeżeli uczestnik ten wyraził na to zgodę, przepisu ust. 1 pkt 4 lit. a nie stosuje się do tego uczestnika, chyba że KDPW_CCP nie wykonał zobowiązania będącego treścią tego uzgodnienia w następstwie okoliczności, za które ponosi odpowiedzialność.

6. Uczestnik nie jest uprawniony do jednostronnego rozwiązania umowy o uczestnictwo w związku ze zmianą warunków, o których mowa w § 108b ust. 1 pkt 1 lub 2, lub zastosowaniem przez KDPW_CCP uprawnienia, o którym mowa w § 108c ust. 1. W takim przypadku przepisu ust. 1 pkt 4 lit. a nie stosuje się.”;

27/ w § 113 ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. W razie wystąpienia przypadku naruszenia po stronie uczestnika naruszającego, KDPW_CCP jest uprawniony do:

1/ rozwiązania w trybie natychmiastowym umowy o uczestnictwo zawartej z tym uczestnikiem (pozbawienie uczestnictwa), wraz z transakcjami przyjętymi do rozliczenia, których stroną rozliczenia jest ten uczestnik, ze skutkiem następującym w momencie wyznaczonym zgodnie z ust. 2, oraz

a/ zamknięcia pozycji zarejestrowanych na kontach rozliczeniowych prowadzonych dla tego uczestnika w drodze operacji aukcji, lub

b/ wykonania działań, o których mowa w §§ 100-106,

2/ powstrzymania się od wykonywania umowy o uczestnictwo zawartej z uczestnikiem naruszającym w trybie określonym w § 121,

3/ odmowy dalszego przyjmowania transakcji do rozliczenia, w których rozliczeniu miałyby uczestniczyć uczestnik naruszający, chyba że inny uczestnik posiada status uczestnika rozliczającego w zakresie tych transakcji i został wskazany do ich rozliczenia.”;

28/ w § 121 po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:

„2a. Zagrożenie, o którym mowa w ust. 1 pkt 1, powstaje również w przypadku rozpoznania przez KDPW_CCP ryzyka prania pieniędzy oraz finansowania terroryzmu związanego z podejmowanymi przez uczestnika stosunkami gospodarczymi, w szczególności w związku z informacją o zastosowaniu wobec niego środków ograniczających zgodnie z właściwymi przepisami prawa, informacją o wszczęciu postępowania w związku ze świadczeniem usług finansowych, na podstawie którego mogą zostać wobec niego zastosowane sankcje administracyjne za naruszenie przepisów prawa obowiązujących uczestnika, lub informacją o wydaniu wobec niego decyzji w sprawie zastosowania tych sankcji administracyjnych.”;

29/ § 136 otrzymuje brzmienie:

„§ 136

W przypadku, jeżeli w regulaminie dokonuje się zmiany, która wprowadza obowiązek dostarczenia przez uczestników rozliczających lub podmioty ubiegające się o status uczestnika dodatkowych dokumentów, uczestnicy, którzy w dniu wejścia w życie tych zmian posiadają ten status, są zobowiązani

do dostarczenia do KDPW_CCP tych dokumentów w terminie dwóch tygodni od otrzymania od KDPW_CCP wezwania w tej sprawie, oraz dokumenty mają zostać dostarczone według wzoru sporządzonego przez KDPW_CCP, po udostępnieniu przez KDPW_CCP uczestnikom tego wzoru, chyba że dłuższy termin wynika z treści uchwały Rady Nadzorczej w sprawie tej zmiany regulaminu.”;

30/ występujący w § 1 i nast. Regulaminu wyraz „TARGET2” zastępuje się wyrazem „TARGET”;

31/ występujące w § 1 i nast. Regulaminu wyrażenie „KDPW_CCP S.A.” zastępuje się wyrażeniem „KDPW_CCP”.

§ 2

Uchwała wchodzi w życie dwa tygodnie po opublikowaniu przez Zarząd KDPW_CCP S.A. uchwały zatwierdzonej przez Komisję Nadzoru Finansowego.

Przewodniczący Rady Nadzorczej

dr Marek Dietl