

Warszawa, dnia 16 maja 2017 r.

Poz. 948

**ROZPORZĄDZENIE
MINISTRA ROZWOJU I FINANSÓW¹⁾**

z dnia 8 maja 2017 r.

w sprawie danych i informacji przekazywanych przez podmioty prowadzące depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi oraz system rozrachunku

Na podstawie art. 68f ust. 4 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi (Dz. U. z 2016 r. poz. 1636, 1948 i 1997 oraz z 2017 r. poz. 724, 768 i 791) zarządza się, co następuje:

§ 1. Rozporządzenie określa:

- 1) szczegółowy zakres danych, o których mowa w art. 68f ust. 1 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi, zwanej dalej „ustawą”,
- 2) szczegółowy zakres informacji, o których mowa w art. 68f ust. 2 ustawy
– oraz terminy przekazywania tych danych i informacji przez podmioty prowadzące depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi oraz system rozrachunku.

§ 2. 1. Podmiot prowadzący depozyt papierów wartościowych lub system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi przekazuje Prezesowi Narodowego Banku Polskiego, zwanemu dalej „Prezesem NBP”, dane o:

- 1) wartości zarejestrowanych instrumentów finansowych, z uwzględnieniem rodzaju instrumentu finansowego,
- 2) wartości zaewidencjonowanych operacji w depozycie papierów wartościowych lub systemie rejestracji instrumentów finansowych,
- 3) liczbie zarejestrowanych emitentów papierów wartościowych, w podziale na emitentów krajowych i zagranicznych
– według stanu na ostatni dzień każdego miesiąca w danym kwartale.

2. Wartość zarejestrowanych instrumentów finansowych, o której mowa w ust. 1, stanowi ich wartość rynkowa ustalona według zasad stosowanych w danym depozycie papierów wartościowych lub systemie rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi.

3. Dane, o których mowa w ust. 1, są przekazywane w terminie do ostatniego dnia miesiąca następującego po miesiącu kończącym dany kwartał.

§ 3. 1. W zakresie działalności rozrachunkowej podmiot prowadzący system rozrachunku przekazuje Prezesowi NBP miesięczne dane o:

- 1) liczbie i wartości przeprowadzonych rozrachunków;
- 2) liczbie i wartości rozrachunków nieprzeprowadzonych w zamierzonej dacie rozrachunku;

¹⁾ Minister Rozwoju i Finansów kieruje działem administracji rządowej – instytucje finansowe, na podstawie § 1 ust. 2 pkt 4 rozporządzenia Prezesa Rady Ministrów z dnia 30 września 2016 r. w sprawie szczegółowego zakresu działania Ministra Rozwoju i Finansów (Dz. U. poz. 1595).

- 3) liczbie dni operacyjnych;
- 4) dostępności operacyjnej i przepustowości systemu rozrachunku.

2. Podmiot prowadzący system rozrachunku przekazuje Prezesowi NBP dane o gwarantowanej przepustowości systemu rozrachunku oraz liście uczestników pośrednich, w zakresie działalności rozrachunkowej.

3. Dane, o których mowa w ust. 1 pkt 1 i 2, są przekazywane z uwzględnieniem rodzaju instrumentu finansowego, waluty oraz rodzaju rynku obrotu.

4. Dane, o których mowa w:

- 1) ust. 1 – są przekazywane w terminie do ostatniego dnia miesiąca następującego po miesiącu kończącym dany kwartał;
- 2) ust. 2 – są przekazywane w terminie 7 dni od dnia, odpowiednio, ustalenia lub zmiany gwarantowanej przepustowości oraz ustalenia lub zmiany listy uczestników pośrednich.

§ 4. 1. W zakresie działalności rozliczeniowej podmiot prowadzący system rozrachunku przekazuje Prezesowi NBP miesięczne dane o:

- 1) liczbie i wartości transakcji podlegających rozliczeniu;
- 2) liczbie dni operacyjnych;
- 3) liczbie i wartości transakcji podlegających rozliczeniu w odniesieniu do poszczególnych uczestników;
- 4) wartości środków wykorzystanych w ramach systemu zabezpieczenia płynności rozliczeń;
- 5) dostępności operacyjnej i przepustowości systemu rozrachunku;
- 6) wynikach testów warunków skrajnych, jakie zostały przeprowadzone.

2. Podmiot prowadzący system rozrachunku przekazuje Prezesowi NBP dane o:

- 1) gwarantowanej przepustowości systemu rozrachunku,
- 2) liście uczestników pośrednich,
- 3) wartości ekspozycji kredytowych poszczególnych uczestników bezpośrednich na ten podmiot, według stanu na ostatni dzień kwartału

– w zakresie działalności rozliczeniowej.

3. Dane, o których mowa w ust. 1:

- 1) pkt 1 i 3 – są przekazywane z uwzględnieniem rodzaju instrumentu finansowego, waluty oraz rodzaju rynku obrotu;
- 2) pkt 2 – są przekazywane z uwzględnieniem rodzaju rynku obrotu.

4. Dane, o których mowa w:

- 1) ust. 1 – są przekazywane w terminie do ostatniego dnia miesiąca następującego po miesiącu kończącym dany kwartał;
- 2) ust. 2:
 - a) pkt 1 i 2 – są przekazywane w terminie 7 dni od dnia, odpowiednio, ustalenia lub zmiany gwarantowanej przepustowości oraz ustalenia lub zmiany listy uczestników pośrednich,
 - b) pkt 3 – są przekazywane w terminie do ostatniego dnia miesiąca następującego po miesiącu kończącym dany kwartał.

§ 5. 1. Jeżeli podmiot prowadzący system rozrachunku w zakresie działalności rozliczeniowej stanowi CCP, przekazuje Prezesowi NBP dane o zmianach parametrów ryzyka wykorzystywanych przez CCP do wyznaczania wstępnych depozytów zabezpieczających, o których mowa w art. 1 pkt 5 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) nr 153/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniającego rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących wymogów obowiązujących kontrahentów centralnych (Dz. Urz. UE L 52 z 23.02.2013, str. 41, z późn. zm.²⁾), zwanego dalej „rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) nr 153/2013”, oraz zmianach wskaźników redukcji wartości zabezpieczeń.

²⁾ Zmiana wymienionego rozporządzenia została ogłoszona w Dz. Urz. UE L 137 z 26.05.2016, str. 1.

2. Jeżeli podmiot prowadzący system rozrachunku w zakresie działalności rozliczeniowej stanowi CCP, dane, o których mowa w § 4:

- 1) ust. 1 pkt 4 – są przekazywane w podziale na środki wykorzystane z wstępnych depozytów zabezpieczających, o których mowa w art. 1 pkt 5 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) nr 153/2013, własnych zasobów celowych, o których mowa w art. 35 ust. 1 tego rozporządzenia, wpłaty do funduszu rozliczeniowego oraz pozostałych kapitałów własnych podmiotu;
- 2) ust. 2 pkt 3 – są przekazywane w podziale na wstępne depozyty zabezpieczające, o których mowa w art. 1 pkt 5 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) nr 153/2013, wpłaty do funduszy rozliczeniowych, linie kredytowe wykorzystane przez CCP, linie kredytowe przyznane i niewykorzystane przez CCP oraz pozostałe ekspozycje.

3. Dane, o których mowa w ust. 1, są przekazywane w terminie 7 dni od dnia, odpowiednio, zmiany parametrów ryzyka oraz zmiany wskaźników redukcji wartości zabezpieczeń.

§ 6. Podmiot prowadzący depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi lub system rozrachunku wraz z danymi, o których mowa w § 2 ust. 1, § 3 ust. 1 i 2, § 4 ust. 1 i 2 oraz § 5 ust. 1, przekazuje informację o swojej nazwie oraz o nazwie prowadzonego depozytu papierów wartościowych, systemu rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi lub systemu rozrachunku.

§ 7. 1. Podmiot prowadzący depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi lub system rozrachunku przekazuje niezwłocznie Prezesowi NBP informację o incydencie, o którym mowa w art. 68f ust. 2 ustawy, obejmującą:

- 1) nazwę podmiotu prowadzącego depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi lub system rozrachunku;
- 2) nazwę depozytu papierów wartościowych, systemu rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi lub systemu rozrachunku;
- 3) opis incydentu, ze wskazaniem:
 - a) daty i godziny wystąpienia i zakończenia incydentu oraz jego wykrycia,
 - b) przyczyny incydentu,
 - c) wpływu incydentu na funkcjonalność operacyjną depozytu lub systemu, ze wskazaniem czasu niedostępności,
 - d) opisu przebiegu incydentu;
- 4) opis skutków incydentu;
- 5) opis działania podjętego w celu usunięcia skutków incydentu;
- 6) planowane działania w celu zapobieżenia wystąpieniu podobnych przypadków w przyszłości.

2. Jeżeli niezwłocznie po wystąpieniu incydentu nie jest możliwe przekazanie danych, o których mowa w ust. 1 pkt 3 lit. b–d lub pkt 4–6, podmiot prowadzący depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi lub system rozrachunku przekazuje wstępną informację o incydencie, a następnie uzupełnia ją w terminie 3 miesięcy od dnia zakończenia incydentu.

§ 8. 1. Podmiot prowadzący depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi lub system rozrachunku po raz pierwszy przekazuje dane:

- 1) o których mowa w § 2 ust. 1, § 3 ust. 1 oraz § 4 ust. 1 i ust. 2 pkt 3, za pierwszy pełny kwartał następujący po kwartale, w którym rozporządzenie weszło w życie;
- 2) o których mowa w § 3 ust. 2, § 4 ust. 2 pkt 1 i 2, oraz dane o stosowanych parametrach ryzyka i wskaźnikach redukcji wartości zabezpieczeń, o których mowa w § 5 ust. 1, w terminie 7 dni od dnia wejścia w życie rozporządzenia.

2. Przepis § 7 stosuje się do incydentów, o których mowa w art. 68f ust. 2 ustawy, które miały miejsce po dniu wejścia w życie rozporządzenia.

§ 9. Rozporządzenie wchodzi w życie po upływie 14 dni od dnia ogłoszenia.