

**Uchwała Nr 962/12**  
**Zarządu Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.**  
**z dnia 18 grudnia 2012 r.**

§ 1

Na podstawie § 2 ust. 1 Regulaminu Giełdowej Izby Rozrachunkowej Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A., Zarząd Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. przyjmuje „Szczegółowe zasady zabezpieczania, rozliczania i rozrachunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.”, w brzmieniu określonym w załączniku do niniejszej uchwały.

§ 2

Z dniem wejścia w życie niniejszej uchwały traci moc uchwała Nr 775/10 Zarządu Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. z dnia 1 grudnia 2010 r. (z późn. Zm.).

§ 3

Uchwała wchodzi w życie z dniem 1 stycznia 2013 r.

dr Iwona Sroka  
Prezes Zarządu

Sławomir Panasiuk  
Wiceprezes Zarządu

Michał Stępniewski  
Członek Zarządu

**Szczegółowe zasady**  
**zabezpieczania, rozliczania i rozrachunku**  
**Giełdowej Izby Rozrachunkowej**  
**Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.**

ZAŁĄCZNIK DO UCHWAŁY Nr 962/12 ZARZĄDU KRAJOWEGO DEPOZYTU PAPIERÓW  
WARTOŚCIOWYCH S.A.  
Z DNIA 18 GRUDNIA 2012 R.

## § 1

Szczegółowe zasady zabezpieczania, rozliczania i rozrachunku Giełdowej Izby Rozrachunkowej Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A., dalej zwane Szczegółowymi zasadami, określają szczegółowe zasady funkcjonowania giełdowej izby rozrachunkowej, o których mowa w § 2 ust. 1 Regulaminu Giełdowej Izby Rozrachunkowej Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A., dalej zwanego Regulaminem.

## § 2

Stosowane w niniejszych Szczegółowych zasadach a niezdefiniowane poniżej pojęcia mają znaczenie nadane im w § 3 Regulaminu. Ilekroć w Szczegółowych zasadach mowa jest o:

- 1/ Bieżącym kursie rozliczeniowym/Bieżącym kursie rozliczenia – rozumie się przez to bieżącą cenę rynkową towaru giełdowego wyznaczaną przez Krajowy Depozyt w celu ustalenia wysokości depozytów zabezpieczających,
- 2/ Depozycie transakcyjnym – rozumie się przez to depozyt transakcyjny, o którym mowa w § 42b Regulaminu,
- 3/ Zabezpieczeniu zlecenia – rozumie się przez to wydzieloną z Depozytu transakcyjnego wniesionego przez członka Izby, kwotę środków blokowaną na Rachunku rozliczeniowym tego członka w chwili złożenia przez niego zlecenia,

4/ Zabezpieczeniu transakcji – rozumie się przez to wydzieloną z Depozytu transakcyjnego wniesionego przez członka Izby, kwotę środków blokową na Rachunku rozliczeniowym tego członka, zabezpieczającą rozliczenie pojedynczej transakcji, w okresie od jej zawarcia do momentu naliczenia i ustanowienia Depozytu rozliczeniowego, Depozytu uzupełniającego oraz innych uzgodnionych z Krajowym Depozytem zabezpieczeń,

5/ Depozycie uzupełniającym – rozumie się przez to depozyt uzupełniający, o którym mowa w § 42d Regulaminu,

6/ Depozycie rozliczeniowym – rozumie się przez to depozyt rozliczeniowy, o którym mowa w § 42c Regulaminu,

7/ REK GPW – rozumie się przez to Rynek Dobowo – Godzinowy Energii Elektrycznej prowadzony przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.,

8/ RTE GPW – rozumie się przez to Rynek Terminowy Energii Elektrycznej prowadzony przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.,

9/ Umowie o członkostwo – rozumie się przez to umowę, o której mowa w Rozdziale II Regulaminu,

10/ członku Izby – rozumie się przez to podmiot, który zawarł z Krajowym Depozytem Umowę o członkostwo,

11/ indeksie poDeeK – rozumie się przez to indeks giełdowy na REK GPW obliczany przez Giełdę codziennie dla każdej godziny dostawy jako średnia ważona wolumenem obrotu wszystkich transakcji giełdowych zawartych na tą godzinę w notowaniach ciągłych oraz w systemie kursu jednolitego na REK GPW publikowany po zakończeniu obrotu na najbliższy dzień dostawy,

12/ SKJ – rozumie się przez to system kursu jednolitego na REK GPW na serie towarów giełdowych godzinowe składający się z fixingu i dogrywki, na którym wyznaczany jest kurs jednolity,

13/ Cenie zlecenia – rozumie się przez to cenę, po której członek Giełdy składa zlecenie sprzedaży (minimalną cenę) lub kupna (maksymalną cenę) towarów giełdowych,

14/ Cenie transakcji – rozumie się przez to cenę, po której została zawarta na giełdzie umowa kupna/sprzedaży towaru giełdowego na podstawie złożonych zleceń.

### § 3

1. Krajowy Depozyt dokonuje zabezpieczania złożonych zleceń oraz zabezpieczania, rozliczania i rozrachunku transakcji zawartych na:

1/ REK GPW w systemie notowań ciągłych i systemie kursu jednolitego,

2/ RTE GPW w systemie notowań ciągłych i w ramach transakcji pozasesyjnych,

3/ przetargach RTE GPW.

2. Szczegółowe warunki i zasady wykonywania czynności, o których mowa w ust. 1 pkt 3, określone zostają każdorazowo pomiędzy rozliczającym członkiem Izby a Krajowym Depozytem na podstawie odpowiedniego wniosku złożonego przez tego członka do Krajowego Depozytu.

### § 4

1. Zabezpieczanie, rozliczanie, rozrachunek oraz fakturowanie na REK GPW i RTE GPW prowadzone są w złotych polskich.

2. Przed wykonaniem czynności, o których mowa w ust. 1 do wartości netto doliczany jest podatek VAT, jeśli wynika to z odpowiednich przepisów prawa.

### § 5

1. W celu wyznaczenia wysokości Depozytu uzupełniającego oraz zabezpieczenia uzupełniającego złożonego zlecenia, Krajowy Depozyt wprowadza komunikatem współczynniki korygujące:

1/FS1 i FS2 – dla zleceń i transakcji sprzedaży,

2/FK1 i FK2 – dla zleceń i transakcji kupna.

2. W celu wyznaczenia wartości zabezpieczeń w postaci Uprawnień do emisji, Krajowy Depozyt wprowadza komunikatem współczynnik uznania FR.

#### § 6

1. Bieżący kurs rozliczeniowy wyznaczany jest dla każdej serii towarów giełdowych notowanej na RTE GPW.

2. Bieżący kurs rozliczeniowy wyznaczany jest codziennie nie później niż 30 minut po zakończeniu obrotu na najbliższy dzień dostawy, ale nie wcześniej niż po opublikowaniu indeksów poDeek REK GPW przez Giełdę.

#### § 7

1. Dla danej wystandaryzowanej serii towarów giełdowych w okresie jej notowania, Bieżący kurs rozliczeniowy wyznaczany jest jako średnia cena ważona wolumenem z ostatnich pięciu (lub mniejszej jeżeli nie zawarto pięciu) transakcji na RTE GPW zawartych przed końcem obrotu na najbliższy dzień dostawy, z wyłączeniem transakcji zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeek” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”.

2. Jeżeli nie można dla danej wystandaryzowanej serii towarów giełdowych wyznaczyć Bieżącego kursu rozliczeniowego zgodnie z ust. 1, wówczas Bieżący kurs rozliczeniowy wyznaczany jest na podstawie tego samego standardu o najbliższym wcześniejszym terminie dostawy wynikającym z harmonogramu, a w przypadku braku wcześniejszej serii towarów giełdowych o tym samym standardzie, określany jest komunikatem Krajowego Depozytu.

3. Dla wystandaryzowanej serii towarów giełdowych w okresie jej realizacji, Bieżący kurs rozliczeniowy wyznaczany jest jako średnia cena ważona odpowiednim wolumenem z cen wyznaczonych wg poniższych zasad:

1/ dla miesiąca dostawy, dla którego trwa realizacja, cena wyznaczana jest zgodnie z § 9 a wolumen wynika z harmonogramu pozostałych dostaw tego miesiąca realizacji, oraz

2/ dla pełnych kolejnych trzech miesięcy czekających na realizację zaczynających się od 1 kwietnia, 1 lipca, 1 października, które odpowiadają harmonogramowi wystandaryzowanej serii kwartalnej towarów giełdowych, cena wyznaczana jest zgodnie z zasadami opisanymi w ust. 1 a wolumen wynika z ilości jednostkowej towaru giełdowego z tej wystandaryzowanej serii towarów giełdowych, oraz

3/ dla pełnych miesięcy czekających na realizację, których nie można przyporządkować żadnej wystandaryzowanej serii kwartalnej towarów giełdowych, a odpowiadają harmonogramowi wystandaryzowanej serii miesięcznej towarów giełdowych, cena wyznaczana jest zgodnie z zasadami opisanymi w ust. 1, a wolumen wynika z ilości jednostkowej towaru giełdowego z tej wystandaryzowanej serii towarów giełdowych.

4. W przypadku znacznego odchylenia Bieżącego kursu rozliczeniowego od aktualnych cen rynkowych, Krajowy Depozyt może określić komunikatem wartość Bieżącego kursu rozliczeniowego dla danej serii towarów giełdowych.

#### § 8

W przypadku niewystandaryzowanych serii towarów giełdowych, od dnia zawarcia transakcji do końca jej realizacji, do obliczania Bieżącego kursu rozliczeniowego odpowiednio stosuje się § 9.

## § 9

1. Bieżący kurs rozliczeniowy dla wystandaryzowanych serii towarów giełdowych w miesiącu ich realizacji, obliczany jest jako średnia ważona wolumenem z harmonogramu dostaw dla każdej godziny określonego typu dnia dostawy odpowiednich średnich arytmetycznych z N ostatnich publikowanych notowań indeksów poDeeK REK GPW przez Giełdę, gdzie N jest wprowadzany komunikatem Krajowego Depozytu.
2. Na potrzeby wyznaczania średnich arytmetycznych z indeksów poDeeK wyróżnia się trzy typy dni dostawy:
  - 1/ Dni robocze,
  - 2/ soboty,
  - 3/ niedziele i święta.

## § 10

1. Na wartość Zabezpieczenia zlecenia złożonego na REK GPW może składać się:
  - 1/ wartość towarów giełdowych, będących przedmiotem zlecenia,
  - 2/ wartość innych opłat i dodatkowych zabezpieczeń uzgodnionych pomiędzy członkiem Izby i Krajowym Depozytem.
2. Składniki Zabezpieczenia zlecenia przedstawia poniższa tabela:

Zlecenie	Wartość towarów giełdowych	Inne opłaty i zabezpieczenia
Sprzedaży	0	Zgodnie z ust. 1 pkt 2
Kupna	Wolumen x Cena zlecenia + podatek VAT	Zgodnie z ust. 1 pkt 2

3. Na wartość Zabezpieczenia transakcji zawartej na REK GPW może składać się:
  - 1/ wartość towarów giełdowych, będących przedmiotem transakcji,
  - 2/ wartość innych opłat i dodatkowych zabezpieczeń uzgodnionych pomiędzy członkiem Izby i Krajowym Depozytem.
4. Zawarcie transakcji powoduje przekształcenie na Rachunku rozliczeniowym Zabezpieczenia zlecenia w Zabezpieczenie transakcji. Składniki Zabezpieczenia transakcji zawartej na REK GPW przedstawia poniższa tabela:

Transakcja	Wartość towarów giełdowych	Inne opłaty i zabezpieczenia
Sprzedaży	0	Zgodnie z ust. 3 pkt 2
Kupna	Wolumen x Cena transakcji + podatek VAT	Zgodnie z ust. 3 pkt 2

## § 11

1. Na wartość Zabezpieczenia zlecenia złożonego na RTE GPW może składać się:
  - 1/ wartość towarów giełdowych dostarczanych przez pierwszych 7 dni kalendarzowych od pierwszego dnia dostawy zgodnie ze złożonym zleceniem,
  - 2/ wartość zabezpieczenia uzupełniającego złożonego zlecenia, a także
  - 3/ wartość innych opłat i dodatkowych zabezpieczeń złożonego zlecenia uzgodnionych pomiędzy członkiem Izby i Krajowym Depozytem.
2. Wartość zabezpieczenia uzupełniającego złożonego zlecenia naliczana jest oddzielnie dla każdego zlecenia na podstawie Bieżącego kursu rozliczeniowego z dnia złożenia zlecenia.

3. Składniki Zabezpieczenia zlecenia złożonego na RTE GPW przedstawia poniższa tabela:

Zlecenie	Wartość towarów giełdowych	Zabezpieczenie uzupełniające złożonego zlecenia	Inne opłaty i zabezpieczenia
Sprzedaży	0	Zgodnie z § 12 ust. 1-3	Zgodnie z ust. 1 pkt 3
Kupna	Wolumen wynikający z dostawy w pierwszych 7 dniach kalendarzowych x Cena zlecenia + podatek VAT	Zgodnie z § 12 ust. 4-6	Zgodnie z ust. 1 pkt 3

4. Dla zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”, w celu ustanowienia wartości towarów giełdowych za Cenę zlecenia przyjmuje się obowiązujący dla danej serii towarów giełdowych Bieżący kurs rozliczeniowy w chwili złożenia zlecenia.

#### § 12

1. Wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia sprzedaży na daną serię towarów giełdowych składa się z sumy dwóch składników powiększonych o podatek VAT:

1/ iloczynu różnicy Bieżącego kursu rozliczenia i Ceny zlecenia, wolumenu zlecenia oraz współczynnika korygującego FS1 oraz

2/ iloczynu współczynnika korygującego FS2 i wolumenu zlecenia.

2. Dla różnicy Bieżącego kursu rozliczenia i Ceny zlecenia sprzedaży mniejszej od zera przyjmuje się wartość zero.

3. Dla zleceń sprzedaży z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”, różnicę Bieżącego kursu rozliczenia oraz Ceny zlecenia przyjmuje się jako zero.

4. Wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia kupna na daną serię towarów giełdowych składa się z sumy dwóch składników powiększonych o podatek VAT:

1/ iloczynu różnicy Ceny zlecenia i Bieżącego kursu rozliczenia, wolumenu zlecenia oraz współczynnika korygującego FK1 oraz

2/ iloczynu współczynnika korygującego FK2 i wolumenu zlecenia.

5. Dla różnicy Ceny zlecenia kupna oraz Bieżącego kursu rozliczenia mniejszej od zera przyjmuje się wartość zero.

6. Dla zleceń kupna z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”, różnicę Ceny zlecenia oraz Bieżącego kursu rozliczenia przyjmuje się jako zero.

#### § 13

1. Na wartość Zabezpieczenia transakcji może składać się:

1/ wartość towarów giełdowych dostarczanych przez pierwszych 7 dni kalendarzowych od pierwszego dnia dostawy zgodnie z zawartą transakcją,

2/ wartość zabezpieczenia uzupełniającego zawartej transakcji,

3/ wartość innych opłat i dodatkowych zabezpieczeń transakcji uzgodnionych pomiędzy członkiem Izby i Krajowym Depozytem.

2. Zawarcie transakcji powoduje przekształcenie Zabezpieczenia zlecenia w Zabezpieczenie transakcji. Składniki Zabezpieczenia transakcji przedstawia poniższa tabela:

Transakcja	Wartość towarów giełdowych	zabezpieczenie uzupełniające zawartej transakcji	Inne opłaty i zabezpieczenia
Sprzedaży	0	Zgodnie z § 14 ust. 6-8	Zgodnie z ust. 1 pkt 3
Kupna	Wolumen wynikający z dostawy w pierwszych 7 dniach kalendarzowych x Cena transakcji + podatek VAT	Zgodnie z § 14 ust. 9-11	Zgodnie z ust. 1 pkt 3

3. Dla transakcji zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”, w celu ustanowienia wartości towarów giełdowych za Cenę transakcji przyjmuje się Bieżący kurs rozliczeniowy z dnia złożenia zlecenia.

#### § 14

1. Depozyt uzupełniający naliczany i ustanawiany jest we wszystkie Dni robocze, przy czym ustanowienie takiego depozytu następuje w ciągu 2 godzin od jego naliczenia.
2. Depozyt uzupełniający naliczany jest w ciągu 90 minut od wyznaczenia aktualnego Bieżącego kursu rozliczeniowego.
3. Krajowy Depozyt udostępnia członkom Izby aktualną wysokość Depozytu uzupełniającego niezwłocznie po jego naliczeniu.
4. Depozyt uzupełniający członka Izby stanowi sumę jego zabezpieczeń uzupełniających naliczonych niezależnie dla każdej serii towarów giełdowych powiększoną o podatek VAT.
5. Zabezpieczenie uzupełniające dla danej serii towarów giełdowych stanowi sumę zabezpieczeń uzupełniających wyliczonych oddzielnie dla transakcji sprzedaży i kupna. Jeżeli wyliczona suma jest mniejsza od zera, wartość zabezpieczenia uzupełniającego przyjmuje wartość zero.
6. Wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji sprzedaży na daną serię towarów giełdowych składa się z sumy dwóch składników:
  - 1/ iloczynu różnicy Bieżącego kursu rozliczenia oraz Ceny transakcji, wolumenu niezrealizowanej części transakcji i współczynnika korygującego FS1 oraz
  - 2/ iloczynu współczynnika korygującego FS2 i wolumenu niezrealizowanej części transakcji.
7. Dla różnicy Bieżącego kursu rozliczenia oraz Ceny transakcji sprzedaży mniejszej od zera przyjmuje się FS1=1.
8. Dla transakcji sprzedaży zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”, różnicę Bieżącego kursu rozliczenia oraz Ceny transakcji przyjmuje się jako zero.
9. Wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji kupna na daną serię towarów giełdowych składa się z sumy dwóch składników:
  - 1/ iloczynu różnicy Ceny transakcji oraz Bieżącego kursu rozliczenia, wolumenu niezrealizowanej części transakcji i współczynnika korygującego FK1 oraz
  - 2/ iloczynu współczynnika korygującego FK2 i wolumenu niezrealizowanej części transakcji.

10. Dla różnicy Ceny transakcji kupna oraz Bieżącego kursu rozliczenia mniejszej od zera przyjmuje się FK1=1.
11. Dla transakcji kupna zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeek” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”, różnicę Ceny transakcji i Bieżącego kursu rozliczenia przyjmuje się jako zero.
12. W przypadku braku środków pieniężnych i/lub niepieniężnych form zabezpieczeń na ustanowienie Depozytu uzupełniającego, Krajowy Depozyt wzywa członka Izby do natychmiastowego uzupełnienia tego Depozytu.
13. Przez natychmiastowe uzupełnienie Depozytu uzupełniającego w postaci środków pieniężnych, Krajowy Depozyt uznaje podstawienie środków na Rachunku rozliczeniowym lub w pełni autoryzowane potwierdzenie wykonania dyspozycji przelewu na Rachunek rozliczeniowy członka Izby w następnym Dniu roboczym do godziny 12.30.

#### § 15

1. W celu wniesienia Uprawnień do emisji tytułem Depozytu transakcyjnego lub Depozytu uzupełniającego, członek Izby zwraca się do Krajowego Depozytu z wnioskiem o wyrażenie zgody na uznanie danych Uprawnień do emisji jako przedmiotu Depozytu transakcyjnego lub Depozytu uzupełniającego. Wzór wniosku stanowi załącznik Nr 3.
2. Po wyrażeniu przez Krajowy Depozyt zgody, o której mowa w ust. 1, członek Izby transferuje Uprawnienia do emisji na RPU oraz informuje o tym Krajowy Depozyt.
3. Depozyty ustanowione zgodnie z poprzedzającymi ustępami, obowiązują od następnego Dnia roboczego po transferze Uprawnień do emisji na RPU.
4. Uprawnienia do emisji, o których mowa w ust. 1-3, są wyceniane w każdy Dzień roboczy do godziny 10.00 wg kursu zamknięcia z poprzedniego dnia notowania na giełdzie BlueNext z siedzibą w Paryżu oraz aktualnego w chwili wyceny kursu kupna euro w NBP zgodnie ze wzorem:

$$W = P * V * E * F_R$$

W – wartość zabezpieczenia w PLN; P – cena zamknięcia Uprawnień do emisji;  
 V – wolumen wycenianych Uprawnień do emisji; E – kurs kupna dla EUR w NBP z chwili wyceny Uprawnień do emisji; F<sub>R</sub> – współczynnik uznania wprowadzany komunikatem Krajowego Depozytu.

5. W przypadku braku konieczności utrzymywania Depozytów, o których mowa w ust. 1, na wniosek członka Izby, Krajowy Depozyt zwraca temu członkowi Uprawnienia do emisji na jego rachunek w KRU. Wzór wniosku stanowi załącznik Nr 5.
6. Członek Izby jest zobowiązany, najpóźniej na 30 dni kalendarzowych przed upływem okresu obowiązywania Uprawnień do emisji, wnieść inne aktywa niepieniężne tytułem Depozytu transakcyjnego lub Depozytu uzupełniającego.
7. W przypadku braku spełnienia warunku, o którym mowa w ust. 6, członek Izby zobowiązany jest postawić do dyspozycji Krajowego Depozytu odpowiednie środki pieniężne na swoim Rachunku rozliczeniowym.

#### § 16

1. Gwarancja bankowa stanowiąca niepieniężną formę zabezpieczeń może być udzielona wyłącznie przez bank akceptowany przez Krajowy Depozyt i powinna zawierać bezwarunkowe i nieodwołalne zobowiązanie banku do natychmiastowej zapłaty, na każde żądanie Krajowego Depozytu, kwoty do wysokości określonej w gwarancji.
2. Członek Izby proponując złożenie zabezpieczenia w formie gwarancji bankowej, zobowiązany jest do określenia tytułu zabezpieczenia oraz przedłożenia Krajowemu Depozytowi projektu dokumentu gwarancji bankowej, który wymaga akceptacji Krajowego Depozytu.



3. Przez natychmiastową zapłatę rozumie się uznanie rachunku bankowego Krajowego Depozytu w dniu zgłoszenia żądania, jeżeli zgłoszenie nastąpiło do godziny 12.30, albo w dniu następnym, jeżeli zgłoszenie nastąpiło po godzinie 12.30.
4. Każda wypłata dokonana w ramach gwarancji automatycznie zmniejsza kwotę zobowiązań członka Izby, aż do całkowitego wyczerpania kwoty gwarancji.
5. Na wniosek członka Izby, Krajowy Depozyt udziela informacji dotyczącej akceptowania banku wskazanego przez członka Izby, jako wystawcy gwarancji bankowej stanowiącej przedmiot zabezpieczenia składanego przez członka Izby.
6. W przypadku, gdy w okresie obowiązywania gwarancji bankowej przyjętej na poczet zabezpieczenia bank, który jej udzielił, przestał być bankiem akceptowanym przez Krajowy Depozyt, członek Izby, na wezwanie Krajowego Depozytu, zobowiązany jest do niezwłocznego złożenia dokumentu gwarancji bankowej udzielonej przez inny bank spełniający warunki określone w ust. 1 i 2, lub niezwłocznego przedstawienia innej dopuszczalnej przez Krajowy Depozyt formy zabezpieczenia.
7. Członek Izby jest zobowiązany, najpóźniej na 5 Dni roboczych przed upływem okresu obowiązywania gwarancji bankowej, złożyć nowy dokument gwarancji bankowej lub oświadczyć, iż zabezpieczenie zostanie złożone w innej dopuszczalnej przez Krajowy Depozyt formie.

#### § 17

1. Depozyt rozliczeniowy naliczany jest dla członka Izby w dniu T w kwocie stanowiącej sumę dziennych nadwyżek zobowiązań nad należnościami wynikających z ich kompensat ustalonych na dni od T+1 do T+7, gdzie T jest dniem naliczenia Depozytu rozliczeniowego, a T+1 do T+7 są kolejnymi siedmioma dniami dostawy towarów giełdowych.
2. Depozyt rozliczeniowy naliczany jest każdego Dnia roboczego nie później niż 60 minut po opublikowaniu indeksów poDeek REK GPW przez Giełdę.
3. Dla ustanowienia Depozytu rozliczeniowego dostawy towarów giełdowych dla transakcji zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeek” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ” Ceny transakcji wyznaczane są:
  - 1/ na najbliższą dobę dostawy towarów giełdowych na podstawie indeksów poDeek lub kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ, oraz
  - 2/ na pozostałe dni dostawy towarów giełdowych na podstawie odpowiednich aktualnych Bieżących kursów rozliczeniowych, wyliczonych zgodnie z § 9.
4. Krajowy Depozyt udostępnia członkom Izby w Dni robocze plan skompensowanych zobowiązań i należności na najbliższe 7 dni kalendarzowych w oparciu o zawarte dotychczas transakcje, niezwłocznie po ich naliczeniu.
5. Plan ten stanowi jednocześnie wezwanie do uzupełnienia środków na Rachunku rozliczeniowym członka Izby.
6. Rzeczywiste rozliczenie względem planu na kolejne dni dostawy towarów giełdowych może ulec zmianie dla transakcji zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeek” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ”, dla których nie zostały opublikowane jeszcze przez Giełdę odpowiednie indeksy poDeek lub kursy wyznaczane na fixingach porannych SKJ.
7. Zabezpieczenia transakcji są w odpowiedniej kwocie przekształcane w Depozyt rozliczeniowy w momencie jego naliczenia i ustanowienia, z zastrzeżeniem, że:

1/ w przypadku, gdy suma Zabezpieczeń transakcji jest większa od naliczonej kwoty Depozytu rozliczeniowego, nadwyżka jest odblokowywana,

2/ w przypadku, gdy suma Zabezpieczeń transakcji jest niższa od naliczonej kwoty Depozytu rozliczeniowego, brakująca kwota blokowana jest na Rachunku rozliczeniowym członka Izby.

8. Członek Izby musi zapewnić środki na Rachunku rozliczeniowym w wysokości umożliwiającej zablokowanie naliczonej kwoty Depozytu rozliczeniowego w następnym Dniu roboczym do godz. 14.00 po dniu jego naliczenia.

#### § 18

1. Rozliczenie transakcji przeprowadzane jest zgodnie z zasadą kompensacji, o której mowa w § 52 Regulaminu.

2. Dla transakcji zawartych na podstawie zlecenia zawierającego warunek „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeek” Cena transakcji dla dobowej dostawy wyliczana jest zgodnie z algorytmem wskazanym w § 16 Szczegółowych Zasadach Obrotu na Rynku Terminowym Energii Elektrycznej (RTE GPW).

3. Dla transakcji zawartych na podstawie zlecenia zawierającego warunek „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych SKJ” Cena transakcji dla dobowej dostawy wyliczana jest zgodnie z algorytmem wskazanym w § 17 Szczegółowych Zasadach Obrotu na Rynku Terminowym Energii Elektrycznej (RTE GPW).

#### § 19

1. Realizacja płatności następuje w dniu dostawy towarów giełdowych wynikającej z zawartych transakcji. Jeżeli realizacja płatności nie wypada w Dzień roboczy, płatność z tego tytułu realizowana jest w najbliższy następujący po nim Dzień roboczy.

2. Obciążenie Rachunku rozliczeniowego w związku z realizacją płatności, o której mowa w ust. 1, dokonywane jest ze środków stanowiących Depozyt rozliczeniowy.

3. Rozrachunek wykonywany jest w każdy Dzień Roboczy do godziny 14:00.

#### § 20

1. Na podstawie dyspozycji członka Izby, Krajowy Depozyt może dla członka Izby zabezpieczać, pobierać i rozliczać wartość opłat i zabezpieczeń, o których mowa w § 10 ust. 1 pkt 2 i ust. 3 pkt 2, § 11 ust. 1 pkt 3 oraz w § 13 ust. 1 pkt 3.

2. W przypadku, gdy Krajowy Depozyt na podstawie dyspozycji zabezpiecza dla członka Izby wartość opłat i zabezpieczeń, o których mowa w § 10 ust. 1 pkt 2 i ust. 3 pkt 2, § 11 ust. 1 pkt 3 oraz w § 13 ust. 1 pkt 3, przekazanie kwoty zabezpieczenia następuje na wskazany rachunek członka Izby.

#### § 21

1. Jeżeli kwota depozytów zabezpieczających członka Izby będzie niższa od wymaganej, a członek Izby jej nie wniesie lub nie uzupełni, Krajowy Depozyt podejmuje czynności mające na celu zamknięcie Pozycji rejestrowych na kontach ewidencyjnych.

2. Podjęcie tych czynności może także nastąpić w przypadku:

1/ wypowiedzenia umowy o prowadzenie Rachunku rozliczeniowego,

2/ odwołania pełnomocnictwa Krajowego Depozytu do Rachunku rozliczeniowego,

3/ wypowiedzenia Umowy o członkostwo.

3. Podjęcie czynności mających na celu zamknięcie Pozycji rejestrowych na kontach ewidencyjnych powoduje naliczenie i obciążenie członka Izby wszystkimi kosztami z tym związanymi.

4. W przypadku uruchomienia przez Krajowy Depozyt czynności mających na celu zamknięcie Pozycji rejestrowych na kontach ewidencyjnych, członek Izby po

uzupełnienia depozytów zabezpieczających i uregulowaniu zobowiązań wobec Krajowego Depozytu, może wnioskować o odstąpienie od tej procedury, jeśli nie doszło jeszcze do jej pełnego wykonania.

## § 22

1. Faktury VAT z tytułu dostaw towarów giełdowych wynikających z realizacji transakcji zawartych na REK GPW i RTE GPW wystawiane są przez i na Krajowy Depozyt. Do cen netto, zgodnie z obowiązującymi przepisami, doliczany jest podatek VAT.
2. Faktury VAT z tytułu dostaw towarów giełdowych wystawiane są w dniu tych dostaw, oddzielnie dla REK GPW i RTE GPW, z terminem płatności zgodnym z dniem dostawy tych towarów.
3. Jeżeli dzień dostawy nie wypada w Dzień roboczy, wówczas faktury VAT za ten dzień dostawy wystawiane są w najbliższy następujący po nim Dzień roboczy, z terminem płatności zgodnym z datą wystawienia faktury VAT.
4. Podatek VAT wyliczony jest niezależnie dla każdej dobowej dostawy towaru z tytułu realizacji transakcji i zaokrąglany do pełnych groszy.
5. W przypadku, gdy podatek VAT na fakturze wystawionej przez członka Izby zostanie wyliczony inaczej niż w sposób określony w ust. 4, ale zgodnie z przepisami, różnica pomiędzy płatnością wynikającą z faktury VAT i rzeczywistą płatnością zostanie wyrównana na podstawie dyspozycji Krajowego Depozytu do 25 dnia miesiąca po miesiącu, którego różnica dotyczy.
6. W przypadku konieczności korygowania faktury VAT, zostanie wystawiona faktura korygująca VAT. Terminem płatności wskazanym na fakturze będzie dzień rzeczywistej prawidłowej płatności o ile prawidłowa płatność nastąpiła przed wystawieniem faktury korygującej. W przypadku, gdy prawidłowa płatność jeszcze nie nastąpiła, terminem płatności faktury korygującej będzie 14-szy dzień od daty jej wystawienia.

## § 23

1. Faktury VAT z tytułu opłat rozliczeniowych za rozliczone w danym miesiącu dostawy towarów giełdowych oraz opłat za rejestrację w danym miesiącu towarów giełdowych, wystawiane są ostatniego dnia tego miesiąca, z terminem płatności 14 dni od daty wystawienia faktury VAT. Jeżeli ostatni dzień miesiąca nie jest Dniem roboczym, faktury VAT wystawiane są w najbliższy następujący po nim Dzień roboczy.
2. Faktury VAT z tytułu rocznej opłaty członkowskiej wystawiane są do 10 stycznia roku, którego dotyczy, z terminem płatności 14 dni od daty wystawienia faktury VAT, o ile członek Izby nie zgłosi z miesięcznym wyprzedzeniem wypowiedzenia Umowy o członkostwo.
3. W przypadku podpisania Umowy o członkostwo w trakcie roku kalendarzowego, faktura VAT wystawiana jest proporcjonalnie za okres pozostały do końca roku kalendarzowego.
4. Do cen netto zostanie doliczony podatek VAT zgodnie z obowiązującymi przepisami.
5. W przypadku, gdy termin płatności nie przypada w Dzień roboczy, płatność nastąpi w następujący po nim najbliższy Dzień roboczy.
6. Opłaty rozliczeniowe, za rejestrację towarów giełdowych i roczne pobierane są przez Krajowy Depozyt z Rachunku rozliczeniowego członka Izby w terminie płatności wskazanym na fakturze VAT.
7. W przypadku braku środków na Rachunku rozliczeniowym, opłaty zostaną pobrane w późniejszym terminie. Za czas opóźnienia zostaną naliczone odsetki ustawowe, które pobrane zostaną jednocześnie z kwotą opłaty.
8. W przypadku konieczności korygowania faktury VAT, zostanie wystawiona faktura korygująca VAT. Terminem płatności wskazanym na fakturze będzie dzień rzeczywistej

prawidłowej płatności o ile prawidłowa płatność nastąpiła przed wystawieniem faktury korygującej VAT. W przypadku, gdy prawidłowa płatność jeszcze nie nastąpiła, terminem płatności faktury korygującej VAT będzie 14-sty dzień od daty jej wystawienia.

#### § 24

1. Krajowy Depozyt nie ponosi odpowiedzialności w stosunku do członków Izby lub osób trzecich za fizyczną dostawę lub odbiór energii elektrycznej w ramach wykonania zawartych na giełdzie transakcji lub jakiegokolwiek szkody wynikłe z niewykonania lub nienależytego wykonania przez członka Izby dostawy lub odbioru przez tego członka Izby (w całości lub części) energii elektrycznej zakontraktowanej na giełdzie.
2. Członek Izby ponosi ryzyko ograniczeń w dostawach energii elektrycznej przez niego w ilości zakontraktowanej na giełdzie w związku z awariami lub ograniczeniami systemu przesyłowego, a różnice te rozliczać będzie przez Rynek Bilansujący prowadzony przez OSP, bez możliwości podnoszenia jakichkolwiek roszczeń odszkodowawczych w stosunku do Krajowego Depozytu.

## Załącznik Nr 1 - wzory

### Wyznaczanie Bieżącego kursu rozliczeniowego

- Na potrzeby wyznaczania Bieżącego Kursu rozliczeniowego, na podstawie indeksów poDeeK REK GPW, wyróżnia się trzy typy dni dostawy:
  - 1.1. Dni robocze,
  - 1.2. soboty,
  - 1.3. niedziele i święta.
- Bieżący kurs rozliczeniowy obliczana jest zgodnie ze wzorem:

$$C_R = \frac{\sum_{i=1}^r \sum_{j=1}^h \overline{\text{poDeeK}}_{ij} * V_{ij} + \sum_{i=1}^s \sum_{j=1}^h \overline{\text{poDeeK}}_{ij} * V_{ij} + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^h \overline{\text{poDeeK}}_{ij} * V_{ij}}{\sum_{i=1}^r \sum_{j=1}^h V_{ij} + \sum_{i=1}^s \sum_{j=1}^h V_{ij} + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^h V_{ij}}$$

$C_R$  – Bieżący kurs rozliczeniowy;

$\overline{\text{poDeeK}}_{ij}$  – średnia arytmetyczna z wprowadzanej komunikatem Krajowego Depozytu ilości dni notowania odpowiedniego typu wartości indeksów poDeeK REK GPW;

$V$  – wolumen energii elektrycznej w godzinie dostawy wynikający z harmonogramu dostaw;

$r$  – ilość dni roboczych w harmonogramie dostaw;  $s$  – ilość sobót w harmonogramie dostaw;

$n$  – ilość niedziel i świąt w harmonogramie dostaw;  $h$  – ilość godzin w i-tej dobie harmonogramu dostaw;

$i$  – i-ta doba dostawy danego typu z harmonogramu dostaw;  $j$  – j-ta godzina i-tej doby harmonogramu dostaw;

### Rozliczanie pieniężne transakcji

$$R = \sum_{i=1}^s \left( \text{Vol}_i * \text{Cena}_i + \text{VAT}_i \right) - \sum_{j=1}^k \left( \text{Vol}_j * \text{Cena}_j + \text{VAT}_j \right)$$

$R$  – wartość dziennego rozliczenia pieniężnego;

$i$ -ta transakcja sprzedaży;  $s$  – ilość transakcji sprzedaży;  $\text{Vol}_i$  – wolumen dziennej realizacji  $i$ -tej transakcji;

$\text{Cena}_i$  – cena  $i$ -tej transakcji;  $\text{VAT}_i$  – kwota podatku VAT wynikająca z dziennej realizacji  $i$  – tej transakcji;

$j$ -ta transakcja kupna;  $k$  – ilość transakcji kupna;  $\text{Vol}_j$  – wolumen dziennej realizacji  $j$ -tej transakcji kupna;

$\text{Cena}_j$  – cena  $j$ -tej transakcji;  $\text{VAT}_j$  – kwota podatku VAT wynikająca z dziennej realizacji  $j$  – tej transakcji;

$R < 0$  obciążenie Rachunku rozliczeniowego;  $R > 0$  uznanie Rachunku rozliczeniowego;

### Wycena Uprawnień do emisji

Uprawnienia do emisji są wyceniane w Dni robocze do godziny 10.00 wg kursu zamknięcia z poprzedniego dnia notowania na giełdzie BlueNext z siedzibą w Paryżu oraz aktualnego w chwili wyceny kursu kupna euro w NBP zgodnie ze wzorem:

$$W = P * V * E * F_R$$

$W$  – wartość zabezpieczenia w PLN;  $P$  – cena zamknięcia Uprawnień do emisji;

$V$  – wolumen wycenianych Uprawnień do emisji;  $E$  – kurs kupna EUR w NBP z chwili wyceny Uprawnień do emisji;  $F_R$  – współczynnik uznania wprowadzany komunikatem Krajowego Depozytu.

### Wartość zabezpieczenia uzupełniającego zlecenia

- Wartość zabezpieczenia uzupełniającego zlecenia sprzedaży na daną serię towarów giełdowych obliczana jest zgodnie ze wzorem:

$$ZU = ZU_s + ZK_s$$

$ZU$  – wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia sprzedaży na daną serię towarów giełdowych;

$ZU_s$ ,  $ZK_s$  – składnik zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia sprzedaży.

składniki wzoru przyjmują postać:

$$ZU_S = (C_R - C_S) * V_S * F_{S1} + VAT, \text{ przy czym dla } ZU_S < 0 \quad ZU_S = 0$$

$$ZK_S = V_S * F_{S2} + VAT$$

$C_S$  – cena zlecenia sprzedaży;

$V_S$  – wolumen zlecenia sprzedaży;

$C_R$  – Bieżący kurs rozliczeniowy 1 MWh energii elektrycznej danej serii towarów giełdowych z dnia złożenia zlecenia;

$F_{S1}, F_{S2}$  – współczynniki korygujące wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia sprzedaży dla danego standardu towarów giełdowych wprowadzane komunikatem Krajowego Depozytu;

VAT – wartość podatku VAT wynikająca z odpowiednich przepisów prawa.

2. Dla zleceń sprzedaży z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych systemu kursu jednolitego” różnicę cen  $C_R - C_S$  przyjmuje się jako zero.
3. Wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia kupna na daną serię towarów giełdowych obliczana jest zgodnie ze wzorem:

$$ZU = ZU_K + ZK_K$$

$ZU$  – wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia kupna na daną serię towarów giełdowych;

$ZU_K, ZK_K$  – składnik zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia kupna.

składniki wzoru przyjmują postać:

$$ZU_K = (C_K - C_R) * V_K * F_{K1} + VAT, \text{ przy czym dla } ZU_K < 0, \quad ZU_K = 0$$

$$ZK_K = V_K * F_{K2} + VAT$$

$C_K$  – cena zlecenia kupna;

$V_K$  – wolumen zlecenia kupna;

$C_R$  – Cena rynkowa 1 MWh energii elektrycznej dla danej serii towarów giełdowych z dnia złożenia zlecenia;

$F_{K1}, F_{K2}$  – współczynniki korygujące wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla zlecenia kupna dla danego standardu towarów giełdowych wprowadzane komunikatem Krajowego Depozytu;

VAT – wartość podatku VAT wynikająca z odpowiednich przepisów prawa.

4. Dla zleceń kupna z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych systemu kursu jednolitego” różnicę cen  $C_K - C_R$  przyjmuje się jako zero.

### Wartość zabezpieczenia uzupełniającego transakcji

1. Wartość Zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji sprzedaży na daną serię towarów giełdowych obliczana jest zgodnie ze wzorem:

$$ZU_S = \sum_{i=1}^t (C_R - C_i) * V_i * F_{S1} + V_i * F_{S2}, \text{ przy czym dla } (C_R - C_i) < 0, \quad F_{S1} = 1$$

$t$  – ilość transakcji sprzedaży zawartych na daną serię towarów giełdowych;

$ZU_S$  – wartość Zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji sprzedaży na daną serię towarów giełdowych;

$C_i$  – cena i-tej transakcji sprzedaży zawartej na danej serii towarów giełdowych;

$V_i$  – wolumen niezrealizowanej dostawy i-tej transakcji sprzedaży na daną serię towarów giełdowych;

$C_R$  – aktualna Cena rynkowa 1 MWh energii elektrycznej danej serii towarów giełdowych;

$F_{S1}, F_{S2}$  – współczynniki korygujące wartość Zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji sprzedaży wprowadzane dla danego standardu towarów giełdowych komunikatem Krajowego Depozytu.

2. Dla transakcji sprzedaży zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie

rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych systemu kursu jednolitego” różnicę cen  $C_R - C_i$  przyjmuje się jako zero.

3. Wartość Zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji kupna dla danej serii towarów giełdowych obliczana jest zgodnie ze wzorem:

$$ZU_K = \sum_{i=1}^t (C_i - C_R) * V_i * F_{K1} + V_i * F_{K2}, \text{ przy czym dla } (C_i - C_R) < 0, F_{K1} = 1$$

t – ilość transakcji kupna zawartych na daną serię towarów giełdowych;

$ZU_K$  – wartość Zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji kupna na daną serię towarów giełdowych;

$C_i$  – cena i-tej transakcji kupna zawartej na daną serię towarów giełdowych;

$V_i$  – wolumen niezrealizowanej dostawy i-tej transakcji kupna na daną serię towarów giełdowych;

$C_R$  – aktualna Cena rynkowa 1 MWh energii elektrycznej danej serii towarów giełdowych;

$F_{K1}, F_{K2}$  – współczynniki korygujące wartość Zabezpieczenia uzupełniającego dla transakcji kupna wprowadzane dla danego standardu towarów giełdowych komunikatem Krajowego Depozytu.

4. Dla transakcji kupna zawartych na podstawie zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeeK” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych systemu kursu jednolitego” różnicę cen  $C_i - C_R$  przyjmuje się jako zero.

### **Wartość zabezpieczenia uzupełniającego dla serii towarów giełdowych**

Zabezpieczenie uzupełniające ( $ZU_P$ ) dla danej serii towarów giełdowych stanowi sumę zabezpieczeń.

$$ZU_P = ZU_S + ZU_K, \text{ przy czym dla } ZU_P < 0, ZU_P = 0$$

## Załącznik Nr 2 – przetarg

.....  
Nazwa członka Izby

.....  
data

.....  
Adres

.....  
NIP

### **Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.**

#### WNIOSEK O ZABEZPIECZENIE, ROZLICZENIE I ROZRACHUNEK PRZETARGU NA RTE GPW

Zwracamy się z wnioskiem o ustalenie zasad zabezpieczenia, rozliczenia i rozrachunku przetargu przeprowadzonego na naszą rzecz na RTE GPW prowadzonym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

W załączniku przesyłamy propozycje dotyczące:

1. harmonogramu przetargu;
2. zasad wnoszenia zabezpieczenia;
3. sposobu i terminu realizacji rozliczenia transakcji zawartych w ramach przetargu.

Osobą do kontaktu jest.....  
Imię i nazwisko, telefon, adres e-mail

.....  
podpis osoby upoważnionej



### Załącznik Nr 3 – wniosek uznanie Uprawnień do emisji

.....  
Nazwa członka Izby

.....  
data

.....  
Adres

.....  
NIP

### **Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.**

#### wniosek o wyrażenie zgody na uznanie Uprawnień do emisji

Zwracamy się z wnioskiem o uznanie Uprawnień do emisji jako Depozytu transakcyjnego/Depozytu uzupełniającego dla transakcji zawieranych na poee – Rynku Towarowym Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

Zobowiązujemy się przenieść Uprawnienia do emisji w ilości ..... ton obowiązujących w okresie rozliczeniowym od..... do ..... na rachunek Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. w KRU celem zabezpieczenia zleceń i/lub transakcji zawieranych na poee – Rynku Terminowym Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

Wyrażamy zgodę na wycenę zdeponowanych Uprawnień do emisji na rachunku Krajowego Depozytu na warunkach określonych w Szczegółowych zasadach zabezpieczania, rozliczania i rozrachunku GIR KDPW.

Oświadczamy, iż Uprawnienia do emisji, będące przedmiotem niniejszego wniosku, stanowią naszą własność i nie podlegają zastawowi lub innym obciążeniom oraz są wolne od wad prawnych.

Osobą do kontaktu jest.....  
Imię i nazwisko, telefon, adres e-mail

.....  
podpis osoby upoważnionej

### Załącznik Nr 4 – gwarancja bankowa

.....  
Nazwa członka Izby

.....  
data

.....  
Adres

.....  
NIP

**Krajowy Depozyt  
Papierów Wartościowych S.A.**

**WNIOSEK  
O PRZYJĘCIE GWARANCJI BANKOWEJ**

Zwracamy się z wnioskiem o przyjęcie gwarancji bankowej jako Depozytu transakcyjnego/Depozytu uzupełniającego dla transakcji zawieranych na poee - Rynku Towarowym Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

Gwarancja wystawiona jest:

przez .....  
Nazwa i adres banku

do kwoty ..... słownie.....

obowiązuje od dnia..... do dnia.....

Osobą do kontaktu jest.....  
Imię i nazwisko, telefon, adres e-mail

.....  
podpis osoby upoważnionej

**Załącznik Nr 5 – zwrot Uprawnień do emisji**

.....  
Nazwa członka Izby

.....  
data

.....  
Adres

.....  
NIP

**Krajowy Depozyt  
Papierów Wartościowych S.A.**

**WNIOSEK  
O ZWROT Uprawnień do emisji**

Zwracamy się z wnioskiem o zwrot Uprawnień do emisji w ilości..... na nasz rachunek nr ..... w KRU.

Osobą do kontaktu jest.....

Imię i nazwisko, telefon, adres e-mail

.....  
podpis osoby upoważnionej

## Załącznik Nr 6 – rozliczanie

.....  
Nazwa członka Izby

.....  
data

.....  
Adres

.....  
NIP

### **Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.**

#### **WNIOSEK O WSPÓLNE ROZLICZENIE PIENIĘŻNE DLA KLIENTÓW DOMU MAKLERSKIEGO**

Zwracamy się z wnioskiem o dokonywanie wspólnego rozliczenia pieniężnego transakcji zawieranych na poee – Rynku Towarowym Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. dla niżej wymienionych klientów członka Izby.

.....  
Kod klienta

.....  
Kod klienta

.....  
Kod klienta

Wskazujemy Rachunek rozliczeniowy nr .....  
do dokonywania rozliczeń pieniężnych.

Osobą do kontaktu jest.....  
Imię i nazwisko, telefon, adres e-mail

.....  
podpis osoby upoważnionej

## Załącznik Nr 7 - komunikaty

Warszawa, dnia.....

Komunikat nr.....

Giełdowej Izby Rozrachunkowej  
Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.

w sprawie  
ustanowienia wartości współczynników uznania wartości Uprawnień do emisji  
do Depozytu uzupełniającego

Od dnia ..... obowiązują współczynniki uznania  $F_R$ :

Rodzaj uprawnienia	Współczynnik uznania $F_R$

.....  
podpis osoby upoważnionej

Warszawa, dnia.....

Komunikat nr.....

Giełdowej Izby Rozrachunkowej  
Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.  
w sprawie  
ustanowienia wartości współczynników korygujących  
do wyznaczania Zabezpieczenia uzupełniającego

Od dnia ..... obowiązują współczynniki korygujące:

1. dla zleceń bez dodatkowego warunku rozliczania i bez względu na termin zawarcia na ich podstawie transakcji

Standard produktu	Współczynniki dla sprzedaży		Współczynniki dla kupna	
	FS1	FS2 w PLN	FK1	FK2 w PLN
Tydzień Baza				
Tydzień Szczyt				
Tydzień Dolina				
Miesiąc Baza				
Miesiąc Szczyt				
Miesiąc Dolina				
Kwartał Baza				
Kwartał Szczyt				
Kwartał Dolina				
Rok Baza				
Rok Szczyt				
Rok Dolina				
Niewystandaryzowany				

2. dla zleceń z dodatkowym warunkiem rozliczania: „zlecenie rozliczane na bazie wartości indeksów poDeek” lub „zlecenie rozliczane na bazie wartości kursów wyznaczanych na fixingach porannych systemu kursu jednolitego” i bez względu na termin zawarcia na ich podstawie transakcji:

Standard produktu	Współczynniki dla sprzedaży		Współczynniki dla kupna	
	FS1	FS2 w PLN	FK1	FK2 w PLN
Tydzień Baza				
Tydzień Szczyt				
Tydzień Dolina				
Miesiąc Baza				
Miesiąc Szczyt				
Miesiąc Dolina				
Kwartał Baza				
Kwartał Szczyt				
Kwartał Dolina				
Rok Baza				
Rok Szczyt				
Rok Dolina				
Niewystandaryzowany				

.....  
podpis osoby upoważnionej

Warszawa, dnia.....

Komunikat nr.....

Giełdowej Izby Rozrachunkowej  
Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.  
w sprawie  
ustanowienia parametrów do wyliczania średnich wartości poDeeK  
dla wyznaczania Zabezpieczenia uzupełniającego

Od dnia ..... obowiązują następujące parametry:

Typ dnia	Ilość dni notowania indeksów poDeeK
Dzień roboczy	
Sobota	
Niedziele i święta	

.....  
podpis osoby upoważnionej