

Uchwała nr 18/1027/24
Rady Nadzorczej Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.
z dnia 5 kwietnia 2024 r.

w sprawie zmiany Regulaminu Repozytorium Transakcji dla Instrumentów Pochodnych

Na podstawie § 20 ust. 2 pkt 9 Statutu, w związku z art. 48 ust 5a pkt 1 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi (tj. Dz.U. z 2023 r., poz. 646, ze zm.), Rada Nadzorcza Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. postanawia, co następuje:

§ 1

W Regulaminie Repozytorium Transakcji dla Instrumentów Pochodnych stanowiącym załącznik do uchwały Nr 12/510/13 Rady Nadzorczej Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. z dnia 16 kwietnia 2013 r., ze zm., wprowadza się następujące zmiany:

1/ w § 2:

a/ w ust. 1:

- pkt 1 i 2 otrzymują brzmienie:

„1) kontrakcie pochodnym/kontrakcie – rozumie się przez to instrument pochodny, o którym mowa w art. 2 pkt 5 Rozporządzenia EMIR, lub pozycję wynikającą z tego instrumentu pochodnego;

2) kontrahencie – rozumie się przez to podmiot będący stroną kontraktu pochodnego raportowanego do repozytorium transakcji;”;

- pkt 10-13 otrzymują brzmienie:

„10) KUR – rozumie się przez to podmiot posiadający dostęp do informacji o kontraktach pochodnych na podstawie art. 78 ust. 7 zdanie drugie rozporządzenia EMIR, zgody uczestnika oraz na podstawie zawartej z KDPW umowy o poufności;

11) podmiocie odpowiedzialnym za raportowanie – rozumie się przez to podmiot, którego obowiązek dokonywania zgłoszeń raportów do repozytorium transakcji, w imieniu kontrahenta, wynika z przepisów prawa;

12) podmiocie uprawnionym – rozumie się przez to podmiot uprawniony do komunikacji z repozytorium transakcji będący uczestnikiem albo podmiotem o statusie KUR;

13) dniu roboczym – rozumie się przez to każdy dzień tygodnia, który nie jest sobotą, niedzielą oraz wskazanym przez Europejski Bank Centralny, dniem, w którym nie działa system TARGET;”;

b/ ust 2 i 3 otrzymują brzmienie:

„2. KDPW zamieszcza na swojej stronie internetowej informację dotyczącą:

1) szczegółowego sposobu przekazywania raportów do repozytorium transakcji oraz sposobu dokonywania korekt raportów o kontraktach pochodnych;

2) sposobu dostępu do danych repozytorium transakcji;

3) zakresu i formatu komunikatu wskazującego, że uczestnik raportujący posiada upoważnienie podmiotu odpowiedzialnego za raportowanie lub kontrahenta, do raportowania w ich imieniu.

3. Uczestnik repozytorium ma obowiązek raportowania zgodnie z wymogami dotyczącymi zakresu, terminów i formatu danych przekazywanych do repozytorium transakcji, określonymi w obowiązujących przepisach prawa oraz dokumentach opublikowanych na podstawie tych przepisów przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA).”;

2/ w § 3:

a/ ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Uczestnikiem repozytorium może być kontrahent lub podmiot odpowiedzialny za raportowanie albo podmiot upoważniony przez kontrahenta lub przez podmiot odpowiedzialny za raportowanie do przekazywania raportów do repozytorium transakcji.”,

b/ w ust. 2:

- w pkt 1 lit. a otrzymuje brzmienie:

„a) przekazywania do repozytorium transakcji raportów o kontraktach, których jest stroną, lub których stroną jest podmiot, za którego raportowanie jest odpowiedzialny, albo raportów w imieniu innego kontrahenta, w tym raportów o kontraktach, których ten uczestnik nie jest stroną,”,

- w pkt 2 lit. a otrzymuje brzmienie:

„a) przekazywania do repozytorium transakcji raportów o kontraktach, których jest stroną, jak również raportów w imieniu kontrahenta będącego drugą stroną transakcji własnej tego uczestnika,”,

- w pkt 3 lit. a otrzymuje brzmienie:

„a) przekazywania do repozytorium transakcji raportów o kontraktach, których jest stroną, wyłącznie w imieniu własnym,”,

- pkt 4 otrzymuje brzmienie:

„4) pośredni uczestnik repozytorium – uczestnik nie raportujący do repozytorium transakcji, będący kontrahentem lub podmiotem odpowiedzialnym za raportowanie, uprawniony do:

a) dostępu do danych dotyczących kontraktów pochodnych, których jest stroną, lub których stroną jest podmiot, za którego raportowanie jest odpowiedzialny,

b) dokonywania korekt raportów dotyczących kontraktów, których jest stroną, w trybie, o którym mowa w § 14 ust. 2.”;

3/ w § 4:

a/ ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Podmiot zamierzający uzyskać status uczestnika repozytorium składa oświadczenie o zamiarze zawarcia umowy w tej sprawie, w postaci wniosku skierowanego do KDPW, w formie pisemnej lub elektronicznej (w postaci dokumentu opatrzonego kwalifikowanym podpisem elektronicznym).”,

b/ w ust. 2:

- pkt 3 skreśla się,

- pkt 4 otrzymuje brzmienie:

„4) oświadczenie stwierdzające, że wnioskodawca zapoznał się z treścią Regulaminu oraz informacji, o których mowa w § 2 ust. 2, oraz że zobowiązuje się do postępowania zgodnego z ich treścią;”,

- po pkt 4 dodaje się pkt 4a w brzmieniu:

„4a) oświadczenie stwierdzające, że wnioskodawca zobowiązuje się do raportowania zgodnie z wymogami dotyczącymi zakresu, terminów i formatu danych przekazywanych do repozytorium transakcji, określonymi w obowiązujących przepisach prawa oraz dokumentach opublikowanych na podstawie tych przepisów przez ESMA;”,

- pkt 5 otrzymuje brzmienie:

„5) oświadczenie, w sprawie miejsca siedziby działalności gospodarczej lub stałego miejsca prowadzenia działalności gospodarczej, dla którego zawierana jest umowa o uczestnictwo - 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. Urz. UE L 77 z 23.3. 2011r.), wraz ze wskazaniem numeru identyfikacji podatkowej wnioskodawcy;”,

- dodaje się pkt 7 w brzmieniu:

„7) oświadczenie wskazujące posiadany zgodnie z Rozporządzeniem EMIR status kontrahenta (kontrahent niefinansowy, kontrahent finansowy, CCP, inny kontrahent).”;

4/ w § 7:

a/ w ust. 1 zdanie drugie skreśla się,

b/ w ust. 2 dodaje się pkt 4 w brzmieniu:

„4) oświadczenie, w sprawie miejsca siedziby działalności gospodarczej lub stałego miejsca prowadzenia działalności gospodarczej, dla którego zawierana jest umowa o poufności - 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. Urz. UE L 77 z 23.3. 2011r.), wraz ze wskazaniem numeru identyfikacji podatkowej wnioskodawcy.”;

5/ w § 10 ust. 2 i 3 otrzymują brzmienie:

„2. Dostępnyymi interfejsami komunikacyjnymi z repozytorium transakcji są:

1) dla uczestników w typie GUR oraz ZUR - interfejs U2A oraz interfejs A2A;

2) dla uczestników w typie IUR, PUR oraz podmiotów o statusie KUR – interfejs U2A oraz interfejs A2A dostępny wyłącznie poprzez kolejkę wyjściową, poprzez którą podmioty te mogą odbierać dedykowany dla tej kolejki typ komunikatów.

3. Dostęp do interfejsów komunikacyjnych, o których mowa w ust. 2, podmiot uprawniony uzyskuje w oparciu o nadany mu przez KDPW czteroznakowy kod instytucji. Na wniosek podmiotu uprawnionego będącego uczestnikiem raportującym do repozytorium transakcji, KDPW może nadać mu więcej niż jeden kod instytucji.”;

6/ § 10a:

a/ w ust. 1 dodaje się zdanie ostatnie w brzmieniu:

„Uczestnik zobowiązany jest upoważnić przynajmniej jedną osobę do dostępu do repozytorium transakcji z wykorzystaniem interfejsu U2A.”,

b/ po ust 2 dodaje się ust. 2a i 2b w brzmieniu:

„2a. W ramach kanału komunikacyjnego, uwierzytelnionego certyfikatem, o którym mowa w ust. 2, KDPW udostępnia parę kolejek komunikacyjnych odrębnie dla każdego kierunku komunikacji, oraz kolejkę wyjściową, przeznaczoną wyłącznie do odbierania dedykowanych komunikatów. Kolejki komunikacyjne przypisywane są podmiotom uprawnionym przez KDPW, w zakresie przysługujących uprawnień. Komunikaty nieodebrane, KDPW usuwa z kolejek wyjściowych po upływie 100 godzin od momentu ich dostarczenia do kolejki.

2b. Podstawowym kanałem komunikacji z repozytorium transakcji jest interfejs U2A. KDPW doręcza wszystkie komunikaty wyjściowe kanałem U2A, a dodatkowo kanałem A2A, jeśli tym kanałem przekazany został komunikat, z którym powiązany jest komunikat zwrotny.”;

7/ w § 11 ust. 8 skreśla się;

8/ § 12 otrzymuje brzmienie:

„§ 12

1. Raport o kontrakcie pochodnym powinien zawierać informacje określone wymaganym zakresem danych, o którym mowa w § 2 ust. 3, przedstawione zgodnie z określonym formatem.

2. Niewypełnienie w raporcie pól określonych jako wymagane zgodnie z wymaganym zakresem danych, o którym mowa w § 2 ust. 3, lub nie zachowanie wymaganego formatu danych, spowoduje odrzucenie raportu przez repozytorium transakcji.

3. W przekazywanym do repozytorium raporcie o kontrakcie pochodnym uczestnik zobowiązany jest do posługiwania się kodami identyfikacyjnymi wymaganymi przez KDPW, zgodnie z wymaganym zakresem oraz formatem danych, o którym mowa w § 2 ust. 3.”;

9/ po § 12 dodaje się § 12a w brzmieniu:

„§ 12a

1. Przekazywanie raportów przez uczestnika raportującego w imieniu podmiotu odpowiedzialnego za raportowanie lub kontrahenta wymaga uprzedniego przekazania do repozytorium dedykowanego komunikatu, o którym mowa w § 2 ust. 2 pkt 3. Komunikat powinien wskazywać adres mailowy podmiotu udzielającego upoważnienia do raportowania w jego imieniu, na który KDPW przekaże informację dotyczącą sposobu potwierdzenia przez ten podmiot upoważnienia uczestnika. Rozpoczęcie raportowania przez uczestnika możliwe jest dopiero po otrzymaniu przez KDPW potwierdzenia upoważnienia uczestnika.

2. W celu uzyskania potwierdzenia upoważnienia, o którym mowa w ust. 1, KDPW wysyła na adres mailowy przekazany przez uczestnika w komunikacie, o którym mowa w ust. 1, informację dotyczącą konieczności potwierdzenia upoważnienia uczestnika poprzez dedykowaną do tego celu aplikację KDPW. Potwierdzenie powinno być dokonane w terminie nie przekraczającym 30 dni od dnia przekazania przez uczestnika komunikatu, o którym mowa w ust. 1. Po upływie tego terminu potwierdzenie upoważnienia na podstawie tego komunikatu nie jest możliwe.

3. Uczestnik, o którym mowa w ust. 1, zobowiązany jest do poinformowania podmiotu, w imieniu którego ma rozpocząć raportowanie, o konieczności potwierdzenia jego upoważnienia KDPW.

4. KDPW może, w każdym czasie, zażądać od uczestnika albo bezpośrednio od podmiotu, który udzielił mu upoważnienia, informacji lub dokumentów potwierdzających istnienie tego upoważnienia. KDPW ma również uprawnienie do usunięcia z aplikacji Repozytorium Transakcji EMIR, relacji pomiędzy uczestnikiem a podmiotem, w imieniu którego raportuje, jeśli poweźmie informację, że relacja ta przestała obowiązywać.”;

10/ w § 13:

a/ ust. 3 i 4 otrzymują brzmienie:

„3. Uczestnik raportujący otrzymuje komunikat zwrotny potwierdzający przyjęcie raportu do repozytorium transakcji albo komunikat odrzucający ten raport, nie później niż wymagają tego przepisy prawa, po przeprowadzeniu przez KDPW kontroli zgłoszenia tego raportu.

4. W przypadku przyjęcia zgłoszenia raportu o kontrakcie pochodnym po godzinie 23.59.59, uznaje się, że zgłoszenie raportu zostało przyjęte w następnym dniu roboczym.”,

b/ ust. 6 otrzymuje brzmienie:

„6. KDPW zastrzega sobie możliwość wprowadzenia przerwy technicznej w działaniu aplikacji.”;

11/ § 16 otrzymuje brzmienie:

„§ 16

KDPW przechowuje informacje o kontrakcie pochodnym zgodnie z art. 80 ust. 3 Rozporządzenia EMIR, przez 10 lat od dnia jego rozwiązania.”;

12/ § 17 otrzymuje brzmienie:

„§ 17

1. Dostęp do danych o kontrakcie pochodnym posiadają wyłącznie:

- 1) kontrahent lub podmiot odpowiedzialny za raportowanie, o ile jest uczestnikiem repozytorium;
- 2) uczestnik repozytorium, który przekazuje raporty o danym kontrakcie w imieniu kontrahenta lub podmiotu odpowiedzialnego za raportowanie;
- 3) podmiot posiadający status KUR.

2. KDPW udostępnia dane o kontraktach pochodnych przekazane do repozytorium transakcji organom uprawnionym zgodnie z art. 81 ust. 3 Rozporządzenia EMIR.

3. Podmioty, o których mowa w ust. 1, posiadają dostęp do informacji o kontrakcie pochodnym od dnia przekazania zgłoszenia o zawarciu kontraktu do upływu terminu 10 lat od dnia jego rozwiązania, wyłącznie przy wykorzystaniu interfejsu U2A. Treść przekazanych raportów, informacji zwrotnych oraz komunikatów przekazywanych przez KDPW podmiotom uprawnionym dostępna jest w tym interfejsie w terminie 30 dni od ich zamieszczenia w aplikacji.”;

13/ § 18a otrzymuje brzmienie:

„§ 18a

1. W celu umożliwienia kontrahentowi lub podmiotowi odpowiedzialnemu za raportowanie prawidłowego wykonania obowiązku, o którym mowa w art. 9 Rozporządzenia EMIR, KDPW dokonuje weryfikacji danych zawartych w raporcie o kontrakcie pochodnym w zakresie dotyczącym ich zgodności z danymi przekazanymi przez drugą stronę tego kontraktu pochodnego do repozytorium transakcji KDPW albo do innego repozytorium transakcji.
2. KDPW udostępnia informacje o zgłoszonych kontraktach pochodnych w odniesieniu do każdego dnia roboczego, w tym status uzgodnienia tych kontraktów - stosownie do przypadku - kontrahentowi będącemu uczestnikiem, podmiotowi odpowiedzialnemu za raportowanie będącemu uczestnikiem, uczestnikowi raportującemu w imieniu kontrahenta lub podmiotu odpowiedzialnego za raportowanie oraz podmiotowi o statusie KUR. Zakres, tryb i forma udostępnienia informacji wynika z przepisów prawa, regulaminu oraz umowy o poufności.
3. Podmioty, o których mowa w ust. 2, są zobowiązane do nie ujawniania oraz nie wykorzystywania tych informacji w innym celu niż umożliwienie kontrahentowi i podmiotowi odpowiedzialnemu za raportowanie, prawidłowego wykonania obowiązku, o którym mowa w art. 9 Rozporządzenia EMIR.”;

14/ w § 24 ust. 5 otrzymuje brzmienie:

„5. Wyłącza się odpowiedzialność odszkodowawczą KDPW z tytułu szkody wyrządzonej uczestnikowi repozytorium, podmiotowi odpowiedzialnemu za raportowanie lub kontrahentowi, w związku z niemożnością przyjęcia raportu o kontrakcie pochodnym z przyczyn technicznych, chyba, że została ona wyrządzona z winy umyślnej lub rażącego niedbalstwa.”;

15/ w § 31 ust. 3 otrzymuje brzmienie:

„3. W przypadku uczestnika raportującego, który w dniu upływu terminu wypowiedzenia umowy, posiada w repozytorium transakcji aktywne kontrakty, umowa o uczestnictwo może zostać rozwiązana nie wcześniej niż z dniem zamknięcia ostatniego z tych kontraktów albo z dniem przeniesienia danych o tych kontraktach do innego niż KDPW repozytorium transakcji.”;

16/ w załączniku nr 1 do Regulaminu – Tabela opłat:

a/ pkt 1.2 w rozdziale I. Opłaty pobierane od uczestników raportujących GUR i ZUR, otrzymuje brzmienie:

1.2. Opłata za zgłoszenie transakcji lub pozycji do repozytorium	Opłata pobierana miesięcznie z dołu, od uczestnika
1.2.1. Opłata za zgłoszenie transakcji lub pozycji, której przedmiotem jest kontrakt inny niż wymieniony w pkt. 1.2.2 poniżej	raportującego, naliczana jest od każdej nowej transakcji, jak również od każdej nowej pozycji, zapisanych w repozytorium transakcji w danym miesiącu kalendarzowym, w odniesieniu do każdego kontrahenta będącego stroną kontraktu.
- 0,046 zł od każdej transakcji lub pozycji	Wysokość opłaty naliczonej zgodnie z punktami 1.2.1 oraz 1.2.2 za dany miesiąc, podlega zaokrągleniu w dół do pełnego grosza.
1.2.2 Opłata za zgłoszenie transakcji lub pozycji, której przedmiotem jest kontrakt OTC – 0,138 zł od każdej transakcji lub pozycji	Przez kontrakt OTC należy rozumieć kontrakt, dla którego uczestnik w polu "Venue of Execution" wskazał kod MIC rynku nie będącego rynkiem regulowanym ani rynkiem kraju trzeciego uznanego za rynek ekwiwalentny.

b/ rozdział IV. Opłaty inne otrzymuje brzmienie:

IV. Opłaty inne	
<p>4.1. Opłata za zmianę kodu LEI lub kodu identyfikującego osobę fizyczną, występującego w raporcie dokonywaną na podstawie informacji uzyskanej od innego repozytorium transakcji albo od uczestnika raportującego:</p> <p>4.1.1. w przypadku dokonania zmiany nie więcej niż 50 000 rekordów - 1 000 PLN</p> <p>4.1.2. w przypadku dokonania zmiany więcej niż 50 000 rekordów - 1 200 PLN, zwiększana każdorazowo o 200 PLN przy każdym kolejnym przekroczeniu liczby 50 000 zmienianych rekordów.</p>	<p>Opłata pobierana od uczestnika raportującego w zakresie danej transakcji. Na potrzeby naliczenia opłaty, za rekord uznaje się pole w bazie danych repozytorium, w którym występuje zmieniany kod.</p>
<p>4.2. Opłata za przeniesienie danych jednego kontrahenta do innego repozytorium:</p> <p>4.2.1. w przypadku przeniesienia danych, obejmujących nie więcej niż 10 000 zgłoszonych raportów - 1 000 PLN,</p> <p>4.2.2. w przypadku przeniesienia danych obejmujących więcej niż 10 000 raportów - 1 200 PLN, zwiększana każdorazowo o 200 PLN przy każdym kolejnym przekroczeniu liczby 10 000 zgłoszonych raportów</p>	<p>Opłata naliczana za przeniesienie danych zrealizowane na podstawie jednej dyspozycji uczestnika.</p>
<p>4.3. Opłata za nadanie i utrzymywanie kodu instytucji</p> <p>4.3.1. w przypadku uczestnika w typie generalny uczestnik raportujący, za nadanie ósmego i każdego kolejnego kodu instytucji - 170 PLN</p> <p>4.3.2. w przypadku uczestnika w typie zwykły uczestnik raportujący lub indywidualny uczestnik raportujący, za nadanie drugiego i każdego kolejnego kodu instytucji – 170 PLN</p>	<p>Opłata miesięczna pobierana z dołu za każdy miesiąc utrzymywania kodu instytucji, przy czym za miesiąc, w którym kod został nadany pobierana w pełnej wysokości.</p>

§ 2

- Zmiany Regulaminu, o których mowa w § 1, wchodzi w życie z dniem 29 kwietnia 2024 r., z wyjątkiem zmian, o których mowa w § 1 pkt 16, które wchodzi w życie z dniem 1 maja 2024r.
- Uczestnicy, którzy na dzień wejścia w życie zmian Regulaminu, raportują do repozytorium transakcji kontrakty w imieniu innych podmiotów na podstawie zgłoszonej relacji, zgodnie z § 12 ust. 6 Regulaminu w brzmieniu dotychczasowym, zobowiązani są do uzyskania potwierdzeń istniejących upoważnień do raportowania, w trybie określonym w § 12a Regulaminu - do dnia 7 czerwca 2024r. Po upływie tego terminu, raportowanie w imieniu podmiotu, który nie dokonał potwierdzenia upoważnienia uczestnika, nie będzie możliwe.

§ 3

Uchwała wchodzi w życie z dniem podjęcia.

Przewodniczący Rady Nadzorczej KDPW S.A.

Adrian Kalisz