

Załącznik nr 7 do Kodeksu Postępowania – Procedura Przekazywania Danych

PROCEDURA PRZEKAZYWANIA DANYCH

1. WSTĘP

- 1.1 Procedura Przekazywania Danych („**Procedura**”) określa zakres oraz sposób przekazywania Administratorowi przez Uczestników Fixingu danych i informacji określonych w pkt 3 i 4 Procedury („**Dane**”).
- 1.2 Pojęcia niezdefiniowane w Procedurze mają znaczenie nadane im w Kodeksie Postępowania.
- 1.3 Przekazywanie Danych, o których mowa w pkt. 3.1.6 - 3.1.9 oraz 3.1.11 - 3.1.15, nie podlega pod Procedurę Eskalacji.

2. UZASADNIENIE KONIECZNOŚCI UZYSKANIA NIEZBĘDNYCH INFORMACJI I DANYCH

- 2.1 Przekazywanie Danych Administratorowi służy wykonywaniu obowiązków określonych w Rozporządzeniu o Wskaźnikach Referencyjnych, w szczególności w zakresie:
 - 2.1.1 stwierdzenia, czy Metoda Ustalania Stawek Referencyjnych oraz Metoda Kaskady Danych spełniają warunki określone w Rozporządzeniu o Wskaźnikach Referencyjnych,
 - 2.1.2 walidacji Danych Wejściowych oraz Danych Transakcyjnych poprzez sprawdzenie historyczne, zgodnie z art. 12 ust. 1 lit. c) Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych,
 - 2.1.3 identyfikacji Kwotowań Podejrzanych oraz wszelkich innych sytuacji, które mogą wiązać się z manipulacją lub próbą manipulacji Stawkami Referencyjnymi w rozumieniu MAR (w zakresie Danych, o których mowa w pkt 3 Procedury będących jednocześnie Danymi Transakcyjnymi), zgodnie z art. 14 ust. 1 Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych,
 - 2.1.4 dokonywania przez Administratora oceny zdolności Stawek Referencyjnych do pomiaru Rynku Bazowego, zgodnie z art. 23 ust. 2 Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych,
 - 2.1.5 stwierdzenia, czy proponowana zmiana kluczowego elementu Metody Ustalania Stawek Referencyjnych lub Metody Kaskady Danych powoduje spełnienie kryteriów materialności.
- 2.2 Przekazywanie Danych Administratorowi służy także procedurom analitycznym i innym działaniom związanym z przygotowaniem procesu opracowywania przez Administratora alternatywnych wskaźników referencyjnych.
- 2.3 Administrator zapewnia podjęcie adekwatnych działań w celu zapewnienia, że wykorzystanie Danych nie prowadzi do ujawnienia osobom trzecim stron transakcji, których dotyczą Dane, ani bezpośrednio ani pośrednio (tj. w szczególności, bez wskazywania stron transakcji ale poprzez prezentację informacji w sposób, który umożliwia pośrednią identyfikację stron transakcji).

3. RODZAJE DANYCH

- 3.1 Przekazywane Dane obejmują:

- 3.1.1 dane dotyczące transakcji Depozytu zawartych na rynku pieniężnym z pozostałymi Uczestnikami Fixingu,
- 3.1.2 dane dotyczące kwotowań na każdy z Terminów Fixingowych wskazanych w pkt 6.1 Kodeksu Postępowania, przekazane przez Uczestnika Fixingu, z zastrzeżeniem pkt 4.14,
- 3.1.3 dane o transakcjach Depozytu dla terminu O/N zawartych między uczestnikami fixingu stawki referencyjnej POLONIA, przekazywane na potrzeby raportowania do NBP,
- 3.1.4 dane o transakcjach Depozytu w złotych o oprocentowaniu stałym zawartych przez Uczestnika Fixingu z instytucjami kredytowymi niebędącymi Uczestnikami Fixingu oraz NBP,
- 3.1.5 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu stałym zawartych przez Uczestnika Fixingu z instytucjami kredytowymi – loro, instytucjami finansowymi – banki zagraniczne, niemonetarnymi instytucjami finansowymi, bankami hipotecznymi, bankami spółdzielczymi oraz spółdzielczymi kasami oszczędnościowo-kredytowymi,
- 3.1.6 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu zmiennym zawartych przez Uczestnika Fixingu z instytucjami kredytowymi, niemonetarnymi instytucjami finansowymi, bankami hipotecznymi, bankami spółdzielczymi, spółdzielczymi kasami oszczędnościowo-kredytowymi, instytucjami kredytowymi – loro oraz instytucjami finansowymi – banki zagraniczne oraz NBP,
- 3.1.7 dane o transakcjach sprzedaży papierów wartościowych z przyrzeczeniem odkupu typu REPO oraz transakcji kupna papierów wartościowych z przyrzeczeniem sprzedaży typu REVERSE REPO zawartych przez Uczestnika Fixingu z instytucjami kredytowymi, niemonetarnymi instytucjami finansowymi, bankami hipotecznymi, bankami spółdzielczymi, spółdzielczymi kasami oszczędnościowo-kredytowymi, instytucjami kredytowymi – loro oraz instytucjami finansowymi – banki zagraniczne oraz NBP,
- 3.1.8 dane o transakcjach zwrotnych kupno-sprzedaż papierów wartościowych typu Buy/Sell Back oraz transakcjach zwrotnych sprzedaż-kupno papierów wartościowych typu Sell/Buy Back zawartych przez Uczestnika Fixingu z instytucjami kredytowymi, niemonetarnymi instytucjami finansowymi, bankami hipotecznymi, bankami spółdzielczymi, spółdzielczymi kasami oszczędnościowo-kredytowymi, instytucjami kredytowymi – loro oraz instytucjami finansowymi – banki zagraniczne oraz NBP,
- 3.1.9 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu stałym zawartych przez Uczestnika Fixingu z Zakładem Ubezpieczeń Społecznych, Funduszem Ubezpieczeń Społecznych, Funduszem Rezerwy Demograficznej oraz Funduszem Emerytur Pomostowych,
- 3.1.10 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu stałym zawartych przez Uczestnika Fixingu z pozostałymi niemonetarnymi instytucjami finansowymi,
- 3.1.11 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu zmiennym zawartych przez Uczestnika Fixingu z pozostałymi niemonetarnymi instytucjami finansowymi,
- 3.1.12 dane o transakcjach sprzedaży papierów wartościowych z przyrzeczeniem odkupu typu REPO oraz transakcji kupna papierów wartościowych z

- przrzeczeniem sprzedaży typu REVERSE REPO zawartych przez Uczestnika Fixingu z pozostałymi niemonetarnymi instytucjami finansowymi,
- 3.1.13 dane o transakcjach zwrotnych kupno-sprzedaż papierów wartościowych typu Buy/Sell Back oraz transakcjach zwrotnych sprzedaż-kupno papierów wartościowych typu Sell/Buy Back zawartych przez Uczestnika Fixingu z pozostałymi niemonetarnymi instytucjami finansowymi,
 - 3.1.14 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu stałym zawartych przez Uczestnika Fixingu z przedsiębiorstwami,
 - 3.1.15 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu zmiennym zawartych przez Uczestnika Fixingu z przedsiębiorstwami.
- 3.2 Dane dotyczące transakcji nienegocjowanych nie są objęte zakresem Procedury. Transakcja nienegocjowana to transakcja zawierana według predefiniowanych reguł.
- 3.3 Dla potrzeb zdefiniowania kategorii niemonetarnych instytucji finansowych (instytucji niebankowych):
- 3.3.1 kategoria niemonetarnych instytucji finansowych obejmuje następujące grupy podmiotów:
 - (a) instytucje ubezpieczeniowe,
 - (b) instytucje emerytalne,
 - (c) instytucje inwestycyjne,
 - 3.3.2 określając, które z podmiotów wchodzi w skład kategorii niemonetarnych instytucji finansowych, stosuje się kategorie zgodne Instrukcją FINREP, przy zachowaniu następujących zasad:
 - (a) instytucje ubezpieczeniowe w rozumieniu Procedury odpowiadają następującej kategorii według Instrukcji FINREP:
 - (i) I.2.1. Instytucje ubezpieczeniowe,
 - (b) instytucje emerytalne w rozumieniu Procedury odpowiadają następującej kategorii według Instrukcji FINREP:
 - (i) I.2.2. Fundusze emerytalne,
 - (c) instytucje inwestycyjne w rozumieniu Procedury odpowiadają następującym kategoriom według Instrukcji FINREP:
 - (i) I.1.2.2.2 Fundusze rynku pieniężnego,
 - (ii) I.2.3.1. Fundusze inwestycyjne (z wyłączeniem funduszy rynku pieniężnego),
- 3.4 Kategoria instytucji kredytowej na potrzeby Procedury:
- 3.4.1 obejmuje banki krajowe z uwzględnieniem banków zrzeszających, ale z wyłączeniem banków spółdzielczych oraz banków hipotecznych,
 - 3.4.2 obejmuje oddziały zagranicznych instytucji kredytowych działających w Polsce oraz oddziały banków zagranicznych działających w Polsce, ale z wyłączeniem banków zagranicznych oraz zagranicznych instytucji kredytowych
 - 3.4.3 nie obejmuje banków centralnych,
 - 3.4.4 nie obejmuje spółdzielczych kas oszczędnościowo-kredytowych,

- 3.4.5 nie obejmuje podmiotów, w stosunku do których został wyznaczony zarząd komisaryczny, lub wobec których Bankowy Fundusz Gwarancyjny podjął decyzję o wszczęciu przymusowej restrukturyzacji lub umorzeniu lub konwersji instrumentów kapitałowych.
- 3.5 Kategoria bank zagraniczny obejmuje bank mający siedzibę na terytorium innego niż Rzeczpospolita Polska państwa. Kategoria zagranicznej instytucji kredytowej obejmuje podmioty mające siedzibę na terytorium innego niż Rzeczpospolita Polska państwa, których działalność polega na przyjmowaniu depozytów pieniężnych lub innych funduszy podlegających zwrotowi od klientów oraz na udzielaniu kredytów na swój własny rachunek.
- 3.6 Kategoria instytucji kredytowej - loro obejmuje banki zagraniczne oraz zagraniczne instytucje kredytowe, dla których Uczestnik Fixingu prowadzi rachunek pieniężny.
- 3.7 Kategoria instytucji finansowej - bank zagraniczny obejmuje banki zagraniczne oraz zagraniczne instytucje kredytowe, dla których Uczestnik Fixingu nie prowadzi rachunku pieniężnego.
- 3.8 Kategoria pozostałych niemonetarnych instytucji finansowych na potrzeby Procedury obejmuje podmioty należące do kategorii opisanej w punkcie „I.2. Pozostałe instytucje sektora finansowego” Instrukcji FINREP, z wyłączeniem podmiotów wskazanych w pkt 3.3 jako niemonetarne instytucje finansowe.
- 3.9 Kategoria przedsiębiorstw na potrzeby Procedury obejmuje podmioty należące do następujących kategorii opisanych w Instrukcji FINREP:
- 3.9.1 II.1.1 MSP (Małe i średnie przedsiębiorstwa); oraz
- 3.9.2 II.1.2 Duże przedsiębiorstwa.
- 3.10 Dla potrzeb przekazywania Danych klasyfikacja podmiotów jest dokonywana według stanu faktycznego z dnia przekazywania Danych.
- 3.11 Dane, o których mowa w pkt 3.1.1 – 3.1.6, 3.1.9 – 3.1.11 oraz 3.1.14 – 3.1.15 są przekazywane do godziny 10:00 następnego dnia roboczego następującego po dniu, w którym zostały zawarte transakcje lub zaproponowane kwotowania w rozumieniu pkt 3.1.2 Procedury, będące ich przedmiotem.
- 3.12 Dane, o których mowa w pkt 3.1.7, 3.1.8, 3.1.12 i 3.1.13, dotyczą transakcji zawartych w danym dniu roboczym do godz. 18:00 i są przekazywane do godziny 8:15 następnego dnia roboczego następującego po dniu, w którym transakcje będące ich przedmiotem zostały zawarte.
- 3.13 W przypadku wykrycia przez Uczestnika Fixingu błędu w przekazanych Danych Uczestnik Fixingu przekazuje również korektę wcześniej przekazanych błędnych Danych zawierającą poprawione Dane oraz informację o błędzie nie później niż w najbliższym dniu, w którym zobowiązany jest przekazać następne tego samego rodzaju Dane, następującym po tym jak błąd ten został wykryty.
- 3.14 W związku z przeprowadzaną analizą Danych, Administrator przeprowadza procedurę wyjaśniającą zwracając się drogą elektroniczną lub na piśmie do Uczestnika Fixingu z wnioskiem o niezwłoczne przekazanie wyjaśnień w szczególności w następujących przypadkach:
- 3.14.1 w przypadku stwierdzenia przez Administratora podejrzenia błędu w Danych przekazanych przez Uczestnika Fixingu,

- 3.14.2 w przypadku stwierdzenia różnicy między wartością Kwotowania Modelowego przekazanego przez Uczestnika Fixingu do Administratora w czasie Okna Kontrybucyjnego, a wartością Kwotowania Modelowego, wyznaczoną przez Administratora w wyniku symulacji dokonanej w oparciu o Dane przekazane Administratorowi przez Uczestnika Fixingu na podstawie Procedury.
- 3.15 W ramach procedury wyjaśniającej o której mowa w pkt 3.14, Administrator zwraca się do Uczestnika Fixingu za pośrednictwem Dostawcy Kwotowania odpowiedzialnego w danym dniu za przygotowanie Kwotowania Modelowego drogą elektroniczną lub na piśmie, z wnioskiem o:
- 3.15.1 ponowne przekazanie Danych w sytuacji, o której mowa w pkt 3.14.1 oraz 3.14.2,
 - 3.15.2 ponowną kalkulację i przekazanie Administratorowi Kwotowania Modelowego w sytuacji, o której mowa w pkt 3.14.2,
 - 3.15.3 podjęcie innych stosownych działań mających na celu przeciwdziałanie sytuacjom, o których mowa w pkt 3.14.1 oraz 3.14.2.
- 3.16 Uczestnik Fixingu jest zwolniony z obowiązku, o którym mowa w pkt 3.15.2 w przypadku gdy kalkulacja wartości Kwotowania Modelowego jest niemożliwa, z powodu aktualizacji Systemu Kwotowań Modelowych, w związku z wejściem w życie zmiany Metody Stawek Referencyjnych, która wiąże się ze zmianą Specyfikacji Kwotowań Modelowych w zakresie dotyczącym Kalkulatora Kwotowań, jeśli obowiązek ten dotyczy Dnia Fixingu sprzed dnia wejścia w życie tych zmian.
- 3.17 W przypadku nieprzekazania Danych do godziny, o której mowa w pkt 3.11 i pkt 3.12 Podmiot Przekazujący Dane niezwłocznie informuje Administratora o przyczynach oraz przekazuje Dane wraz z odpowiednią informacją o ich przekazaniu.
- 3.18 Zmiana parametrów transakcji typu: REPO, REVERSE REPO, Sell/Buy Back, Buy/Sell Back („Transakcja Warunkowa”) wynikająca z nieterminowego rozliczenia papieru wartościowego będącego przedmiotem Transakcji Warunkowej na warunkach ustalonych przy zawieraniu Transakcji Warunkowej nie skutkuje powstaniem obowiązku przekazania do Administratora skorygowanych warunków tej Transakcji Warunkowej.
- 3.18.1–Poprzez rozliczenie papieru wartościowego rozumie się obciążenie rachunku papierów wartościowych jednego kontrahenta przy jednoczesnym uznaniu jego rachunku pieniężnego oraz uznanie rachunku papierów wartościowych drugiego kontrahenta przy jednoczesnym obciążeniu jego rachunku pieniężnego.
 - 3.18.2 Nieterminowe rozliczenie papieru wartościowego będącego przedmiotem Transakcji Warunkowej należy odróżnić od innych okoliczności skutkujących anulowaniem Transakcji Warunkowej. Anulowanie Transakcji Warunkowej skutkuje koniecznością przekazania do Administratora korekty Danych polegającej na wyłączeniu anulowanej Transakcji Warunkowej z właściwego rodzaju Danych.

4. ZAKRES DANYCH

- 4.1 Dane wskazane w pkt 3.1.1 oraz 3.1.3 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy i powinny zawierać odpowiednio:
- 4.1.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.1.2 datę waluty zawartej transakcji,

- 4.1.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.1.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.1.5 kwotę transakcji,
 - 4.1.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.1.7 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.1.8 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem odpowiednio pkt 6.1 lub pkt 6.2.
- w przypadku danych wskazanych w pkt 3.1.1;
- 4.1.9 kwotę transakcji,
 - 4.1.10 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.1.11 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem odpowiednio pkt 6.1 lub pkt 6.2,
- w przypadku danych wskazanych w pkt 3.1.3.
- 4.2 Dane wskazane w pkt 3.1.4 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy i powinny zawierać:
- 4.2.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.2.2 datę waluty zawartej transakcji,
 - 4.2.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.2.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.2.5 kwotę transakcji,
 - 4.2.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.2.7 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.2.8 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2,
 - 4.2.9 wskazanie, że kontrahent jest instytucją kredytową.
- 4.3 Dane wskazane w pkt 3.1.5 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy (z wyłączeniem kredytów udzielanych przez Uczestnika Fixingu) i powinny zawierać:
- 4.3.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.3.2 datę waluty zawartej transakcji,
 - 4.3.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.3.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.3.5 kwotę transakcji,
 - 4.3.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.3.7 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.3.8 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2, a jeżeli podanie nazwy kontrahenta nie jest możliwe - wskazanie grupy, z zastrzeżeniem pkt 6.3, do której należy, zgodnie z podziałem wskazanym w pkt 3.3.1 (w przypadku gdy drugą stroną transakcji jest niemonetarna instytucja finansowa) lub wskazanie, że kontrahentem jest bank hipoteczny lub wskazanie, że kontrahentem jest bank spółdzielczy, lub wskazanie, że kontrahentem jest

spółdzielcza kasa oszczędnościowo-kredytowa lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja kredytowa – loro lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja finansowa – bank zagraniczny.

- 4.4 Dane wskazane w pkt 3.1.6 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy (z wyłączeniem kredytów udzielanych przez Uczestnika Fixingu) i powinny zawierać:
- 4.4.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.4.2 datę waluty transakcji,
 - 4.4.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.4.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.4.5 kwotę transakcji,
 - 4.4.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.4.7 wskaźnik referencyjny zastosowany w transakcji,
 - 4.4.8 stopę procentową dla transakcji w pierwszym okresie odsetkowym z uwzględnieniem marży,
 - 4.4.9 z zastrzeżeniem, odpowiednio, pkt 6.1 lub pkt 6.2, nazwę kontrahenta, a jeżeli podanie nazwy kontrahenta nie jest możliwe - wskazanie, z zastrzeżeniem pkt 6.3, że kontrahentem jest instytucja kredytowa lub wskazanie grupy, do której należy, zgodnie z podziałem wskazanym w pkt 3.3.1 (w przypadku gdy drugą stroną transakcji jest niemonetarna instytucja finansowa) lub wskazanie, że kontrahentem jest bank hipoteczny lub wskazanie, że kontrahentem jest bank spółdzielczy lub wskazanie, że kontrahentem jest spółdzielcza kasa oszczędnościowo-kredytowa, lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja kredytowa – loro lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja finansowa – bank zagraniczny.
- 4.5 Dane wskazane w pkt 3.1.7 powinny obejmować transakcje o przepływach pieniężnych w złotych (bez względu na walutę, w której denominowany jest papier wartościowy), o stałej stopie oprocentowania i terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy i powinny zawierać:
- 4.5.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.5.2 datę waluty transakcji,
 - 4.5.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.5.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (REPO lub REVERSE REPO),
 - 4.5.5 datę zapadalności transakcji,
 - 4.5.6 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.5.7 kody ISIN obligacji stanowiących zabezpieczenie
 - 4.5.8 wartość nominalną obligacji stanowiącej zabezpieczenie,
 - 4.5.9 wysokość pierwszego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),
 - 4.5.10 wysokość drugiego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),

- 4.5.11 w miarę możliwości, oznaczenie motywacji zawarcia transakcji (General Collateral (GC) lub Special Collateral (SC)),
 - 4.5.12 nazwę kontrahenta z zastrzeżeniem odpowiednio pkt 6.1 lub pkt 6.2, , a jeżeli podanie nazwy kontrahenta nie jest możliwe - wskazanie grupy, z zastrzeżeniem pkt 6.3, do której należy, zgodnie z podziałem wskazanym w pkt 3.3.1 (w przypadku gdy drugą stroną transakcji jest niemonetarna instytucja finansowa) lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja kredytowa, lub wskazanie, że kontrahentem jest bank hipoteczny lub wskazanie, że kontrahentem jest bank spółdzielczy lub wskazanie, że kontrahentem jest spółdzielcza kasa oszczędnościowo-kredytowa lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja kredytowa – loro lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja finansowa – bank zagraniczny.
- 4.6 Dane wskazane w pkt 3.1.8 powinny obejmować transakcje o przepływach pieniężnych w złotych (bez względu na walutę, w której denominowany jest papier wartościowy), o stałej stopie oprocentowania i terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy i powinny zawierać:
- 4.6.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.6.2 datę waluty transakcji,
 - 4.6.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.6.4 strona transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (Buy/Sell Back lub Sell/Buy Back),
 - 4.6.5 datę zapadalności transakcji,
 - 4.6.6 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.6.7 kody ISIN obligacji stanowiących zabezpieczenie
 - 4.6.8 wartość nominalną obligacji stanowiącej zabezpieczenie,
 - 4.6.9 wysokość pierwszego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),
 - 4.6.10 wysokość drugiego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),
 - 4.6.11 w miarę możliwości, oznaczenie motywacji zawarcia transakcji (General Collateral (GC) lub Special Collateral (SC)),
 - 4.6.12 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem odpowiednio pkt 6.1 lub pkt 6.2, , a jeżeli podanie nazwy kontrahenta nie jest możliwe wskazanie grupy, z zastrzeżeniem pkt 6.3, do której należy, zgodnie z podziałem wskazanym w pkt 3.3.1 (w przypadku gdy drugą stroną transakcji jest niemonetarna instytucja finansowa) lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja kredytowa, lub wskazanie, że kontrahentem jest bank hipoteczny lub wskazanie, że kontrahentem jest bank spółdzielczy lub wskazanie, że kontrahentem jest spółdzielcza kasa oszczędnościowo-kredytowa lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja kredytowa – loro lub wskazanie, że kontrahentem jest instytucja finansowa – bank zagraniczny.
- 4.7 Dane wskazane w pkt 3.1.9 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy (z wyłączeniem kredytów udzielanych przez Uczestnika Fixingu) i powinny zawierać:
- 4.7.1 datę zawarcia transakcji,

- 4.7.2 datę waluty zawartej transakcji,
 - 4.7.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.7.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.7.5 kwotę transakcji,
 - 4.7.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.7.7 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.7.8 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2.
- 4.8 Dane wskazane w pkt 3.1.10 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy (z wyłączeniem kredytów udzielanych przez Uczestnika Fixingu) i powinny zawierać:
- 4.8.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.8.2 datę waluty zawartej transakcji,
 - 4.8.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.8.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.8.5 kwotę transakcji,
 - 4.8.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.8.7 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.8.8 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2.
- 4.9 Dane wskazane w pkt 3.1.11 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy (z wyłączeniem kredytów udzielanych przez Uczestnika Fixingu) i powinny zawierać:
- 4.9.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.9.2 datę waluty transakcji,
 - 4.9.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.9.4 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.9.5 kwotę transakcji,
 - 4.9.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.9.7 wskaźnik referencyjny zastosowany w transakcji,
 - 4.9.8 stopę procentową dla transakcji w pierwszym okresie odsetkowym z uwzględnieniem marży,
 - 4.9.9 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2.
- 4.10 Dane wskazane w pkt 3.1.12 powinny obejmować transakcje o przepływach pieniężnych w złotych (bez względu na walutę, w której denominowany jest papier wartościowy), o stałej stopie oprocentowania i terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy i powinny zawierać:
- 4.10.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.10.2 datę waluty transakcji,
 - 4.10.3 godzinę zawarcia transakcji,

- 4.10.4 strona transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (REPO lub REVERSE REPO),
 - 4.10.5 datę zapadalności transakcji,
 - 4.10.6 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.10.7 kody ISIN obligacji stanowiących zabezpieczenie,
 - 4.10.8 wartość nominalną obligacji stanowiącej zabezpieczenie,
 - 4.10.9 wysokość pierwszego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),
 - 4.10.10 wysokość drugiego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),
 - 4.10.11 w miarę możliwości, oznaczenie motywacji zawarcia transakcji (General Collateral (GC) lub Special Collateral (SC)),
 - 4.10.12 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2.
- 4.11 Dane wskazane w pkt 3.1.13 powinny obejmować transakcje o przepływach pieniężnych w złotych (bez względu na walutę, w której denominowany jest papier wartościowy), o stałej stopie oprocentowania i terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy i powinny zawierać:
- 4.11.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.11.2 datę waluty transakcji,
 - 4.11.3 godzinę zawarcia transakcji,
 - 4.11.4 strona transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (Buy/Sell Back lub Sell/Buy Back),
 - 4.11.5 datę zapadalności transakcji,
 - 4.11.6 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.11.7 kody ISIN obligacji stanowiących zabezpieczenie
 - 4.11.8 wartość nominalną obligacji stanowiącej zabezpieczenie,
 - 4.11.9 wysokość pierwszego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),
 - 4.11.10 wysokość drugiego przepływu pieniężnego (w całości, obejmującego także płatność za narosłe odsetki),
 - 4.11.11 w miarę możliwości, oznaczenie motywacji zawarcia transakcji (General Collateral (GC) lub Special Collateral (SC)),
 - 4.11.12 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2.
- 4.12 Dane wskazane w pkt 3.1.14 powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy (z wyłączeniem kredytów udzielanych przez Uczestnika Fixingu) i powinny zawierać:
- 4.12.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.12.2 datę waluty zawartej transakcji,
 - 4.12.3 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.12.4 kwotę transakcji,
 - 4.12.5 datę zapadalności transakcji,

- 4.12.6 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.12.7 wskazanie czy kontrahent należy do kategorii II.1.1 MSP (poprzez oznaczenie jako MSP) czy do kategorii II.1.2 Duże przedsiębiorstwa (poprzez oznaczenie jako Duże przedsiębiorstwo),
 - 4.12.8 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2.
- 4.13 Dane wskazane w pkt 3.1.15 powyżej powinny obejmować transakcje o terminach zapadalności nie dłuższych niż 18 miesięcy (z wyłączeniem kredytów udzielanych przez Uczestnika Fixingu) i powinny zawierać:
- 4.13.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.13.2 datę waluty transakcji,
 - 4.13.3 stronę transakcji z punktu widzenia Uczestnika Fixingu (DEPO lub LOAN),
 - 4.13.4 kwotę transakcji,
 - 4.13.5 datę zapadalności transakcji,
 - 4.13.6 wskaźnik referencyjny zastosowany w transakcji,
 - 4.13.7 stopę procentową dla transakcji w pierwszym okresie odsetkowym z uwzględnieniem marży,
 - 4.13.8 wskazanie czy kontrahent należy do kategorii II.1.1 MSP (poprzez oznaczenie jako MSP) czy do kategorii II.1.2 Duże przedsiębiorstwa (poprzez oznaczenie jako Duże przedsiębiorstwo),
 - 4.13.9 nazwę kontrahenta, z zastrzeżeniem pkt 6.2.
- 4.14 Dane, o których mowa w pkt 3.1.2 przekazywane są tylko przez tych Uczestników Fixingu, którzy zadeklarują Administratorowi możliwość ich przekazywania.
- 4.15 Za „godzinę zawarcia transakcji” przyjmuje się czas wprowadzenia transakcji do systemu rejestracji tych transakcji przez Uczestnika Fixingu.

5. **SPOSÓB PRZEKAZYWANIA INFORMACJI I DANYCH, SPOSÓB ZABEZPIECZENIA INFORMACJI I DANYCH PRZEZ ADMINISTRATORA**

- 5.1 Dane przekazywane są przez Uczestnika Fixingu zgodnie z szablonem, udostępnionym przez Administratora Uczestnikom Fixingu w terminie 30 dni przed wejściem w życie Kodeksu Postępowania lub zmiany Procedury Przekazywania Danych.
- 5.2 Uczestnicy Fixingu przekazują Administratorowi Dane w formie elektronicznej, w plikach płaskich, w których Dane przechowywane są w sposób liniowy, w formacie .txt lub .csv.
- 5.3 Uczestnicy Fixingu przekazują Administratorowi Dane:
 - 5.3.1 poprzez serwer udostępniony przez Administratora za pośrednictwem dedykowanego modułu PPD Systemu Fixingowego WIBIX,
 - 5.3.2 w zaszyfrowanych plikach za pomocą poczty elektronicznej w przypadku braku możliwości przekazania plików z danymi w sposób określony w pkt 5.3.1.

6. WARUNKI PRAWNE, KTÓRE POZWALAJĄ NA PRZEKAZYWANIE DANYCH I INFORMACJI PRZEZ UCZESTNIKA FIXINGU BEZ NARUSZENIA OBOWIĄZUJĄCYCH PRZEPISÓW PRAWA

- 6.1 Dane identyfikujące kontrahenta będącego Uczestnikiem Fixingu przekazywane są przez Uczestnika Fixingu pod warunkiem otrzymania od innego Uczestnika Fixingu, którego ta informacja dotyczy, pisemnej zgody na przekazanie tej informacji do Administratora, z zastrzeżeniem pkt 6.6. Zgody są przekazywane za pośrednictwem Administratora, który przekazuje kopie tych zgód pozostałym Uczestnikom Fixingu.
- 6.2 Dane identyfikujące kontrahenta niebędącego Uczestnikiem Fixingu przekazywane są przez Uczestnika Fixingu pod warunkiem otrzymania od takiego kontrahenta, którego ta informacja dotyczy, pisemnej zgody na przekazanie tej informacji do Administratora, z zastrzeżeniem pkt 6.6. Zgody są przekazywane za pośrednictwem Administratora, który przekazuje kopie tych zgód Uczestnikom Fixingu.
- 6.3 Jeżeli Uczestnik Fixingu nie posiada możliwości rozdzielenia danych identyfikujących kontrahenta Uczestnika Fixingu w zakresie podmiotów wchodzących w skład kategorii: instytucja kredytowa – loro oraz instytucja finansowa – bank zagraniczny, wówczas przekazywane Administratorowi informacje, o których mowa w pkt 4.3.8, 4.4.9, 4.5.12 oraz 4.6.12, wchodzące w skład obu powyższych kategorii, będą oznaczane przez Uczestnika Fixingu jako dane pochodzące z kategorii instytucja kredytowa - loro. Uczestnik Fixingu zobowiązany jest do niezwłocznego poinformowania Administratora o ustaniu okoliczności, o których mowa w zdaniu poprzednim wskazując jednocześnie termin, od którego Uczestnik Fixingu będzie przekazywał Administratorowi dane z pełną i prawidłową identyfikacją kontrahenta, zgodnie z pkt 4.3.8, 4.4.9, 4.5.12 oraz 4.6.12.
- 6.4 Do momentu uzyskania zgody, o której mowa w pkt 6.1 od NBP, Dane dotyczące transakcji z NBP nie są przekazywane przez Uczestnika Fixingu.
- 6.5 Administrator przekazuje pozostałym Uczestnikom Fixingu kopię Deklaracji Uczestnictwa w Fixingu zawierającą zgodę Uczestnika Fixingu, o której mowa w pkt 6.1.
- 6.6 Przekazywanie, wykorzystanie lub ujawnianie Danych następuje pod warunkiem, że jest to zgodne z przepisami prawa powszechnie obowiązującego oraz pod warunkiem, że Administrator nie będzie ujawniał lub wykorzystywał Danych, w sposób pozwalający na ujawnienie osobom trzecim tajemnicy prawnie chronionej Uczestników Fixingu lub ich kontrahentów, i będzie zachowywał środki, o których mowa w pkt 2.3.

7. TRYB ZMIANY PROCEDURY PRZEKAZYWANIA DANYCH I POSTANOWIENIA PRZEJŚCIOWE

- 7.1 Administrator może dokonać zmiany Procedury po uprzednich konsultacjach z Uczestnikami Fixingu. Zmiana Procedury nie stanowi zmiany Kodeksu Postępowania w rozumieniu pkt 28 Kodeksu Postępowania.
- 7.2 Administrator przekazuje Uczestnikom Fixingu jednolity tekst zmienionej Procedury.
- 7.3 Zmieniona Procedura wchodzi w życie w ciągu 30 dni od otrzymania jej przez Uczestników Fixingu, za wyjątkiem postanowień, o których mowa w pkt 7.5.
- 7.4 Administrator może dokonać zmiany Procedury w terminie krótszym niż wynikający z pkt 7.3, pod warunkiem uzyskania pisemnej zgody wszystkich Uczestników Fixingu, z uwzględnieniem postanowień pkt 7.1.
- 7.5 Postanowienia pkt 3.11 i 3.12 Procedury wchodzi w życie 4 maja 2021 roku

- 7.6 W przypadku gdy Uczestnik Fixingu nie będzie miał możliwości rozpoczęcia przekazywania Danych zgodnie ze zmienionymi postanowieniami pkt 3.11 i 3.12 Procedury poczynawszy od dnia ich wejścia w życie, w terminie **7 dni** od dnia upływu terminu, o którym mowa w pkt 7.3, składa do Administratora pisemny wniosek o ustalenie dla niego innego terminu rozpoczęcia przekazywania Danych, wskazując jednocześnie proponowany termin. Zaproponowany termin powinien przypadać na pierwszy dzień roboczy tygodnia i nie może być późniejszy niż 30 czerwca 2021 r. Administrator niezwłocznie rozpatruje wniosek Uczestnika Fixingu i udziela pisemnej odpowiedzi, wskazując termin rozpoczęcia przekazywania Danych, który jest dla Uczestnika Fixingu wiążący.
- 7.7 We wniosku, o którym mowa w pkt 7.6, Uczestnik Fixingu może zaproponować różne terminy rozpoczęcia przekazywania dla poszczególnych rodzajów Danych, o których mowa w pkt 3.11 lub 3.12
- 7.8 Administrator może wyrazić tymczasową zgodę na zmianę godziny przekazywania Danych, o której mowa w pkt 3.11 (dla Danych, o których mowa w pkt 3.1.6, 3.1.11, 3.1.14 i 3.1.15) oraz w pkt 3.12. Uczestnik Fixingu zwraca się do Administratora o wyrażenie zgody we wniosku, o którym mowa w pkt 7.6, lub w odrębnym pisemnym wniosku, wskazując jednocześnie proponowaną godzinę przekazywania Danych oraz okres obowiązywania zmiany. Administrator niezwłocznie rozpatruje wniosek Uczestnika Fixingu i udziela pisemnej odpowiedzi, wskazując godzinę przekazywania Danych oraz okres obowiązywania zmiany, które są dla Uczestnika Fixingu wiążące.
- 7.9 Wejście w życie zmienionych postanowień pkt 3.11 i 3.12 oraz rozpoczęcie przekazywania Danych zgodnie ze zmienionymi postanowieniami nie zwalniają Uczestnika Fixingu z obowiązku przekazania Danych zgodnie z pkt 3.11 i 3.12, w brzmieniu dotychczasowym, dotyczących transakcji zawartych w tygodniu poprzedzającym tydzień, w którym zmienione postanowienia weszły w życie, lub w okresie od wejścia w życie zmienionych postanowień do chwili rozpoczęcia przekazywania Danych zgodnie z 3.11 i 3.12 w przypadku wyznaczenia innego terminu rozpoczęcia przekazywania danych na podstawie 7.6 i 7.7.
- 7.10 Punkt 3.16 Procedury wchodzi w życie z dniem 6.12.2021 r., w trybie określonym w pkt 7.4 Procedury.