

Wymogi informacyjne dla członków giełdy, o których mowa w Artykule 18 ust. 3. Rozporządzenia Delegowanego Komisji (UE) 2017/584 z dnia 14 lipca 2016 r. uzupełniającego dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających wymogi organizacyjne w zakresie systemów.

1. Dotyczące członka giełdy

KATEGORIA DANYCH	SZCZEGÓŁY
Kategoria składającego wniosek o dopuszczenie do działania na giełdzie oraz członka giełdy	<p>Składający wniosek o dopuszczenie do działania na giełdzie, jak również członek giełdy, zobowiązani są niezwłocznie informować giełdę o wszelkich zmianach danych określonych w przepisach wydanych na podstawie § 65 ust. 2 Regulaminu Giełdy, zawartych we wniosku o dopuszczenie do działania na giełdzie.</p> <p>Składający wniosek o dopuszczenie do działania na giełdzie, jak również członek giełdy określa, czy działa jako:</p> <ul style="list-style-type: none"> - firma inwestycyjna w rozumieniu art. 3 pkt 33) ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi, - zagraniczna firma inwestycyjna nieprowadząca działalności maklerskiej na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej - inny podmiot będący uczestnikiem Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A. - inny podmiot niebędący uczestnikiem Krajowego Depozytu Papierów Wartościowych S.A.
Dane podmiotu składającego wniosek o dopuszczenie do działania na giełdzie oraz członka giełdy	<ol style="list-style-type: none"> 1. Adres siedziby 2. Adres do korespondencji 3. Adres strony internetowej 4. Nr VAT 5. Określenie zakresu działalności prowadzonej na giełdzie 6. Skład osobowy organu zarządzającego wnioskodawcy (osoby uprawnione do zarządzania wnioskodawcą) 7. Struktura własności wnioskodawcy 8. Informacja nt. posiadania przez wnioskodawcę oddziału na terytorium RP (w tym: nazwa oddziału zagranicznego przedsiębiorcy, siedziba i adres oddziału, data rejestracji oddziału w KRS, nr KRS, osoby reprezentujące zagranicznego przedsiębiorcę w oddziale, datę uruchomienia działalności operacyjnej, adres korespondencyjny oddziału, e-mail, telefon, fax, 9. Stosunek zależności wnioskodawcy od innych podmiotów 10. Stosunek dominacji wnioskodawcy wobec innych podmiotów 11. Członkostwo wnioskodawcy na innych rynkach instrumentów finansowych, w instytucjach rozliczeniowych, profesjonalnych stowarzyszeniach 12. Czy wnioskodawca działa na innych rynkach instrumentów finansowych. Jeżeli tak, to w jakich i w jakim charakterze. 13. Lista osób przewidzianych do kontaktów wnioskodawcy z Giełdą innych niż maklerzy nadzorujący, 14. Lista osób przewidzianych do pełnienia funkcji maklera nadzorującego
Inne informacje przekazywane przez podmiot składający wniosek o dopuszczenie do działania na giełdzie oraz członka giełdy	<ol style="list-style-type: none"> 1. Odpis zezwolenia właściwego organu nadzoru na prowadzenie działalności maklerskiej lub inny dokument potwierdzający prawo wnioskodawcy do prowadzenia działalności maklerskiej w zakresie wymaganym do działania na giełdzie. 2. Oświadczenie o zakresie działalności, której zamiar wykonywania przez wnioskodawcę został zgłoszony właściwemu organowi nadzoru. 3. Zobowiązanie wnioskodawcy do poinformowania Giełdy o zamiarze rozpoczęcia prowadzenia działalności maklerskiej na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej.

4. Zobowiązanie wnioskodawcy do złożenia wniosku o zmianę uchwały w sprawie dopuszczenia do działania na giełdzie w przypadku zamiaru rozpoczęcia prowadzenia działalności maklerskiej na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej.
5. Opis wewnętrznej struktury organizacyjnej.
6. Aktualny odpis z właściwego rejestru oraz statut lub umowa spółki.
7. Sprawozdanie finansowe za ostatni rok obrotowy prowadzonej działalności i właściwą opinię podmiotu uprawnionego do badania sprawozdań finansowych. Jeżeli zgodnie z właściwymi przepisami posiadanie takiej opinii na dzień złożenia wniosku nie jest wymagane – sprawozdanie finansowe za ostatni rok obrotowy prowadzonej działalności oraz ostatnie zbadane sprawozdanie finansowe i właściwą opinię do tego sprawozdania. Jeżeli wnioskodawca składa wniosek w trakcie pierwszego roku obrotowego prowadzonej działalności - sprawozdanie finansowe obejmujące okres od rozpoczęcia działalności do ostatniego dnia miesiąca poprzedzającego złożenie wniosku.
8. Sprawozdanie finansowe sporządzone na ostatni dzień miesiąca poprzedzającego złożenie wniosku (jeżeli wnioskodawca posiada takie sprawozdanie).
9. Schemat architektury technicznej zapewniającej prawidłową obsługę obrotu instrumentami notowanymi na giełdzie lub informacja n/t planowanej architektury technicznej oraz warunków jej wdrożenia.
10. Informacja o przewidywanym terminie rozpoczęcia działania na giełdzie.
11. Dokument określający/dokumenty określające obowiązujące u wnioskodawcy zasady nabywania i zbywania instrumentów finansowych notowanych na giełdzie przez członków władz wnioskodawcy lub jego pracowników, których zakres obowiązków obejmuje czynności związane z obrotem giełdowym.
12. Dokument określający/dokumenty określające obowiązujące u wnioskodawcy procedury ochrony tajemnicy informacji związanych z transakcjami giełdowymi.
13. Oświadczenie o zakresie czynności, do wykonywania których wnioskodawca jest uprawniony na podstawie art. 70 ust. 2 Ustawy.

2. Dotyczące zapobiegania zakłóceniom obrotu

KATEGORIA DANYCH	SZCZEGÓŁY
Czy członek giełdy jest zarejestrowany jako firma inwestycyjna lub potwierdza posiadanie notyfikacji działalności transgranicznej	Weryfikacja posiadania przez krajowe podmioty zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego na prowadzenie działalności maklerskiej lub potwierdzenie notyfikowania działalności transgranicznej przez podmioty spoza Rzeczypospolitej Polskiej
Czy członek giełdy prowadzi przedtransakcyjną kontrolę ceny, wolumenu i wartości zleceń oraz korzystania z systemu	<ol style="list-style-type: none"> 1. Przy wprowadzaniu zleceń, w odniesieniu do wszystkich instrumentów finansowych, członek giełdy stosuje następujące środki kontroli przedtransakcyjnej: <ol style="list-style-type: none"> a) przedziały cenowe, które powodują automatyczną blokadę lub anulowanie zleceń niezgodnych z ustalonymi parametrami cenowymi, rozróżniając przy tym różne instrumenty finansowe zarówno na poziomie poszczególnych zleceń, jak i w określonym przedziale czasowym; b) maksymalne wartości zleceń, które uniemożliwiają wprowadzenie do arkusza zleceń o niezwykle wysokiej wartości; c) maksymalne wolumeny zleceń, które uniemożliwiają wprowadzenie do arkusza zleceń o niezwykle dużej wielkości; d) limity maksymalnej liczby komunikatów, które uniemożliwiają przesłanie do arkuszy zleceń nadmiernej liczby komunikatów dotyczących złożenia, modyfikacji lub anulowania zlecenia. 2. Członek giełdy niezwłocznie uwzględnia w obliczeniach limitów przedtransakcyjnych, o których mowa w ust. 1, wszystkie zlecenia przesłane do systemu obrotu. 3. Członek giełdy posiada przepustnice wielokrotnego automatycznego wykonania, które kontrolują liczbę zastosowań strategii handlu algorytmicznego. Po przeprowadzeniu uprzednio określonej liczby wielokrotnych wykonań system

	<p>transakcyjny zostaje automatycznie dezaktywowany do czasu ponownego uruchomienia przez wyznaczonego członka personelu.</p> <ol style="list-style-type: none"> 4. Członek giełdy ustala limity ryzyka rynkowego i ryzyka kredytowego, których podstawę stanowią jej fundusze własne, uzgodnienia rozliczeniowe, strategia handlowa, tolerancja ryzyka, doświadczenie i określone zmienne, takie jak czas, przez jaki członek giełdy zajmuje się handlem algorytmicznym, oraz jej zależność od dostawców będących osobami trzecimi. Członek giełdy dostosowuje wspomniane limity ryzyka rynkowego i ryzyka kredytowego, by uwzględnić zmieniający się wpływ zleceń na dany rynek spowodowany różnymi poziomami cen i płynności. 5. Członek giełdy automatycznie blokuje lub anuluje zlecenia od maklera, jeżeli dowie się, że makler ten nie posiada zezwolenia na obrót danym instrumentem finansowym. Członek giełdy automatycznie blokuje lub anuluje zlecenia, gdy zlecenia te grożą naruszeniem własnych progów ryzyka firmy. W stosownych przypadkach stosuje się środki kontroli w odniesieniu do ekspozycji dotyczących poszczególnych klientów, instrumentów finansowych, maklerów, jednostek odpowiadających za handel lub firmy inwestycyjnej jako całości. 6. Członek giełdy posiada wdrożone procedury i mechanizmy dotyczące postępowania ze zleceniami, które zostały zablokowane w ramach stosowania środków kontroli przedtransakcyjnej firmy inwestycyjnej, lecz które członek giełdy chce mimo to złożyć. Takie procedury i mechanizmy stosuje się w odniesieniu do określonej transakcji tymczasowo i w wyjątkowych okolicznościach. Podlegają one weryfikacji dokonywanej przez komórkę ds. zarządzania ryzykiem i zatwierdzeniu przez wyznaczoną osobę w firmie inwestycyjnej.
<p>Czy członek giełdy prowadzi potransakcyjną kontrolę działalności handlowej</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Członek giełdy w sposób ciągły stosuje środki kontroli potransakcyjnej, które wprowadziła. W przypadku uruchomienia środka kontroli potransakcyjnej członek giełdy podejmuje właściwe działanie, które może obejmować dostosowanie lub wyłączenie odpowiedniego algorytmu handlowego lub systemu transakcyjnego lub też prawidłowe wycofanie się z rynku. 2. Środki kontroli potransakcyjnej, o których mowa w ust. 1, obejmują stałą ocenę i stałe monitorowanie ryzyka rynkowego i ryzyka kredytowego danej firmy inwestycyjnej w kategoriach efektywnej ekspozycji. 3. Członek giełdy przechowuje zapisy informacji dotyczących transakcji i rachunków, które są kompletne, dokładne i spójne. Członek giełdy uzgadnia własne elektroniczne rejestry transakcji z informacjami na temat swoich zleceń oczekujących na realizację i ekspozycji na ryzyko dostarczonymi przez systemy obrotu, do których wysyła zlecenia, przez swoich pośredników lub dostawców usługi bezpośredniego dostępu elektronicznego, przez swoich uczestników rozliczających lub kontrahentów centralnych i przez swoich dostawców danych lub innych odpowiednich partnerów biznesowych. Rejestry należy uzgadniać w czasie rzeczywistym, jeżeli wspomniani uczestnicy rynku dostarczają informacje w czasie rzeczywistym. Członek giełdy jest w stanie obliczać w czasie rzeczywistym swoje należności z tytułu ekspozycji i także należności swoich maklerów i klientów. 4. W przypadku instrumentów pochodnych środki kontroli potransakcyjnej, o których mowa w ust. 1, obejmują środki kontroli odnoszące się do maksymalnych pozycji długich i krótkich oraz ogólnych pozycji strategicznych, a limity obrotu należy ustanowić w jednostkach, które są odpowiednie dla danych rodzajów wykorzystywanych instrumentów finansowych. 5. Monitorowanie potransakcyjne prowadzą maklerzy odpowiedzialni za algorytm oraz komórka kontroli ryzyka danej firmy inwestycyjnej.
<p>Czy członek giełdy spełnia adekwatne wymogi co do kwalifikacji pracowników na kluczowych stanowiskach</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. Członek giełdy zatrudnia wystarczającą liczbę pracowników, którzy posiadają niezbędne umiejętności do obsługi jej systemów handlu algorytmicznego i algorytmów handlowych oraz wystarczającą wiedzę techniczną na temat: <ol style="list-style-type: none"> a) odnośnych systemów transakcyjnych i algorytmów; b) monitorowania i testowania takich systemów i algorytmów; c) strategii handlowych, które członek giełdy wdraża za pośrednictwem swoich systemów handlu algorytmicznego i algorytmów handlowych; d) zobowiązań prawnych firmy inwestycyjnej. 2. Członek giełdy określa niezbędne umiejętności, o których mowa w ust. 1. Pracownicy, o których mowa w ust. 1, są w posiadaniu tych niezbędnych umiejętności na etapie rekrutacji lub nabywają je poprzez szkolenia przeprowadzane po zakończeniu rekrutacji. Członek giełdy zapewnia poprzez ustawiczne szkolenie, by wspomniane umiejętności pracowników pozostawały aktualne, i dokonuje okresowej oceny ich umiejętności.

	<p>3. Szkolenie personelu, o którym mowa w ust. 2, jest dopasowane do doświadczenia i obowiązków pracowników z uwzględnieniem charakteru, skali i złożoności działalności firmy inwestycyjnej. W szczególności pracownicy zajmujący się składaniem zleceń przechodzą szkolenia z zakresu systemów składania zleceń i nadużyć na rynku.</p> <p>4. Członek giełdy zapewnia, by pracownicy odpowiedzialni za zarządzanie ryzykiem i zgodność z przepisami w zakresie handlu algorytmicznego posiadali:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) wystarczającą wiedzę na temat handlu algorytmicznego i strategii handlowych; b) wystarczające umiejętności w zakresie reagowania na informacje pochodzące z automatycznych ostrzeżeń; c) wystarczające uprawnienia, aby zastosować środki dyscyplinarne wobec pracowników odpowiedzialnych za handel algorytmiczny w przypadkach, w których taki handel powoduje zakłócenie obrotu lub prowadzi do podejrzenia wystąpienia nadużycia na rynku.
<p>Czy członek giełdy przeprowadza testy zgodności technicznej i funkcjonalnej (certyfikacja oprogramowania, algorytmów)</p>	<p>1. Członek giełdy (członek giełdy, animator rynku) przeprowadza testy zgodności swoich systemów handlu algorytmicznego i algorytmów handlowych z:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) systemem wykorzystywanym przez system obrotu w każdym z poniższych przypadków: <ul style="list-style-type: none"> (i) podczas uzyskiwania dostępu do tego systemu obrotu w charakterze członka; (ii) podczas pierwszego łączenia się z tym systemem obrotu za pośrednictwem mechanizmu dostępu sponsorowanego; (iii) gdy wystąpiła istotna zmiana w systemach wykorzystywanych przez dany system obrotu; (iv) przed wdrożeniem lub istotną aktualizacją systemu handlu algorytmicznego, algorytmu handlowego lub strategii handlu algorytmicznego danej firmy inwestycyjnej; b) systemem dostawcy usługi bezpośredniego dostępu do rynku w każdym z poniższych przypadków: <ul style="list-style-type: none"> (i) podczas uzyskiwania po raz pierwszy dostępu do tego systemu obrotu za pośrednictwem mechanizmu bezpośredniego dostępu do rynku; (ii) gdy wystąpiła istotna zmiana mająca wpływ na funkcjonalność tego dostawcy pod względem bezpośredniego dostępu do rynku; (iii) przed wdrożeniem lub istotną aktualizacją systemu handlu algorytmicznego, algorytmu handlowego lub strategii handlu algorytmicznego danej firmy inwestycyjnej. <p>2. W testach zgodności weryfikuje się, czy podstawowe elementy systemu handlu algorytmicznego lub algorytmu handlowego funkcjonują prawidłowo oraz zgodnie z wymogami systemu obrotu lub dostawcy usługi bezpośredniego dostępu do rynku. W tym celu w testach weryfikuje się, czy system handlu algorytmicznego lub algorytm handlowy:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) współdziała z logiką zestawiania zleceń systemu obrotu zgodnie z oczekiwaniami; b) odpowiednio przetwarza strumienie danych pobrane z systemu obrotu.
<p>Czy członek giełdy posiada procedury natychmiastowego anulowania wszystkich niezrealizowanych zleceń „kill functionality” oraz potwierdza posiadanie technicznych możliwości stosowania takiej funkcjonalności</p>	<p>Członek giełdy – w ramach środka nadzwyczajnego – jest w stanie natychmiast anulować dowolne lub wszystkie swoje niewykonane zlecenia zgłoszone w dowolnych lub wszystkich systemach obrotu, z którymi członek giełdy jest połączona („funkcja awaryjna”). Niewykonane zlecenia obejmują zlecenia otrzymane od indywidualnych maklerów, jednostek odpowiedzialnych za handel lub – w stosownych przypadkach – klientów. W celu awaryjnego anulowania członek giełdy jest w stanie wskazać, który algorytm handlowy oraz makler, jednostka odpowiedzialna za handel lub – w stosownych przypadkach – klient ponosi odpowiedzialność za każde zlecenie przesłane do systemu obrotu.</p>
<p>Weryfikacja warunków udostępniania przez członka giełdy bezpośredniego dostępu elektronicznego dla swoich klientów</p>	<p>1. Warunkiem rozpoczęcia przez członka giełdy udostępniania danemu klientowi dostępu bezpośredniego jest:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1) przekazanie Giełdzie informacji o dokonanej przez członka giełdy weryfikacji prawa tego klienta do korzystania z dostępu bezpośredniego, 2) przekazanie Giełdzie informacji potwierdzającej spełnienie przez członka giełdy wymogów, o których mowa w § 72a ust. 4 Regulaminu Giełdy, 3) wskazanie Giełdzie maklera nadzorującego odpowiedzialnego za nadzór nad przekazywaniem na giełdę, przez tego klienta, zleceń maklerskich; przepisy § 95 ust. 2 Regulaminu Giełdy stosuje się odpowiednio,

	<ol style="list-style-type: none">4) przekazanie Giełdzie informacji o wyznaczonym przez tego klienta maklerze giełdowym upoważnionym, w imieniu tego klienta, do przekazywania, modyfikowania i anulowania zleceń maklerskich; przepisy § 92 ust. 4 Regulaminu Giełdy stosuje się odpowiednio,5) przekazanie Giełdzie kodu LEI tego klienta,6) przekazanie Giełdzie kodu skróconego („short code”) nadanego temu klientowi przez członka giełdy do oznaczenia zleceń maklerskich składanych przez tego klienta. <ol style="list-style-type: none">2. Członek giełdy zobowiązany jest do przedstawienia, na żądanie Giełdy, sposobu spełnienia wymogów, o których mowa w § 72a ust. 4 Regulaminu Giełdy, jak również wyników weryfikacji, o której mowa w § 72a ust. 4. pkt 2) i 3) tego Regulaminu.3. Informacje, o których mowa w pkt. 1-6 powyżej, członek giełdy zobowiązany jest przekazać co najmniej na dwa dni sesyjne przed dniem udostępnienia danemu klientowi dostępu bezpośredniego. Wzór informacji stanowi Załącznik Nr 6 A do SZOG.4. Warunkiem rozpoczęcia przez członka giełdy udostępniania danemu klientowi dostępu sponsorowanego, poza wymogami, o których mowa w Oddziale 1a § 1c ust. 2 SZOG, jest dodatkowo:<ol style="list-style-type: none">1) przekazanie Giełdzie wyników uprzedniej weryfikacji tego klienta, o której mowa w § 72a ust. 4 pkt 2 Regulaminu Giełdy,2) przeprowadzenie testów połączeń tego klienta z systemami informatycznymi Giełdy,3) przekazanie Giełdzie wyników oceny funkcjonowania mechanizmów kontroli zleceń maklerskich,4) spełnienie niezbędnych dodatkowych warunków organizacyjno-technicznych, o których mowa w umowie o dostęp członka giełdy do systemów informatycznych Giełdy, mających zastosowanie w przypadku udostępniania dostępu sponsorowanego.5. Korzystanie przez danego klienta członka giełdy z dostępu sponsorowanego wymaga uchwały Zarządu Giełdy podjętej na pisemny wniosek członka giełdy. Wzór wniosku stanowi Załącznik Nr 6 B do SZOG.6. Do końca pierwszego kwartału każdego roku kalendarzowego członek giełdy zobowiązany jest przekazać Giełdzie wyniki okresowej weryfikacji klienta korzystającego z dostępu sponsorowanego, o której mowa w § 72a ust. 4 pkt 3 Regulaminu Giełdy, za poprzedni rok kalendarzowy.
--	--