

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 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 z zastrzeżeniem pkt 4.14, dane dotyczące kwotowań na każdy z Terminów Fixingowych wskazanych w pkt 6.1 Kodeksu Postępowania, przekazane przez Uczestnika Fixingu,
- 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 przyrzeczeniem 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 nie bankowych):
 - 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 które realizują program postępowania naprawczego, lub planu naprawy w rozumieniu Prawa Bankowego; nadto: 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 - lora 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 - 3.1.5, 3.1.9 - 3.1.10 oraz 3.1.14 będą przekazywane do godziny 15:00 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 3.1.6 - 3.1.8 oraz 3.1.11 - 3.1.13 oraz 3.1.15 będą przekazywane do godziny 15:00 pierwszego dnia roboczego w tygodniu następującym po tygodniu, w którym były zawarte transakcje będące ich przedmiotem.
- 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 dokonanej przez niego symulacji 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.

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:
- 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 z zastrzeżeniem, odpowiednio, pkt 6.1 lub pkt 6.2, nazwę kontrahenta.
- 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta,
 - 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta, 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 strona 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 z zastrzeżeniem, odpowiednio, pkt 6.1 lub pkt 6.2, nazwę kontrahenta, 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 z zastrzeżeniem, odpowiednio, pkt 6.1 lub pkt 6.2, nazwę kontrahenta, 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta.
- 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta.
- 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta.
- 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 stronę 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta.
- 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 stronę 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta.
 - 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta.
 - 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 z zastrzeżeniem pkt 6.2 nazwę kontrahenta.
 - 4.14 Dane, o których mowa w pkt 3.1.2 będą przekazywane 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 2.2.
7. **TRYB ZMIANY PROCEDURY PRZEKAZYWANIA DANYCH**
- 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.