

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 przez Uczestników Fixingu danych i informacji Administratorowi („Dane”).
- 1.2 Pojęcia niezdefiniowane w Procedurze mają znaczenie nadane im w Kodeksie Postępowania.
- 1.3 Przekazywanie Danych, o których mowa w pkt. 3.1.4 - 3.1.15, nie podlega pod Procedurę Eskalacji.

2. UZASADNIENIE KONIECZNOŚCI UZYSKANIA NIEZBĘDNYCH INFORMACJI I DANYCH

- 2.1 Przekazanie Danych Administratorowi służy do wykonania obowiązków określonych w Rozporządzeniu o Wskaźnikach Referencyjnych, w szczególności:
 - 2.1.1 w zakresie stwierdzenia, czy metoda wyznaczania Stawek Referencyjnych spełnia warunki określone w art. 12 Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych, a w szczególności, czy metoda wyznaczania Stawek Referencyjnych odzwierciedla rynek i realia gospodarcze, których pomiar jest celem Stawek Referencyjnych,
 - 2.1.2 w zakresie identyfikacji Kwotowań Podejrzanych w wykonaniu obowiązków określonych w art. 14 Ust. 1 Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych obejmujących ustanowienie odpowiedniego systemu i skutecznej kontroli w celu zapewnienia rzetelności Kwotowań, aby móc zidentyfikować i zgłosić Właściwemu Organowi każde zachowanie, które może wiązać się z manipulacją lub próbą manipulacji Stawkami Referencyjnymi zgodnie z MAR (w zakresie Danych, o których mowa w pkt. 3.1.1 - 3.1.3),
 - 2.1.3 w zakresie uruchomienia procedury zmiany definicji i metody wyznaczania Stawek Referencyjnych w zakresie koniecznym do dostosowania tej definicji i metody do wymogów Rozporządzenia o Wskaźnikach Referencyjnych.
- 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. 4.8, dane dotyczące Kwotowań na każdy z terminów Depozytów 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 Bank z pozostałymi niemonetarnymi instytucjami finansowymi,
- 3.1.11 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu zmiennym zawartych przez Bank 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 Bank 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 Bank z pozostałymi niemonetarnymi instytucjami finansowymi,
- 3.1.14 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu stałym zawartych przez Bank z przedsiębiorstwami,
- 3.1.15 dane o transakcjach depozytowych w złotych o oprocentowaniu zmiennym zawartych przez Bank z przedsiębiorstwami.
- 3.2 Dla potrzeb zdefiniowania kategorii niemonetarnych instytucji finansowych (instytucji niebankowych):
- 3.2.1 kategoria niemonetarnych instytucji finansowych obejmuje następujące grupy podmiotów:
- (a) instytucje ubezpieczeniowe,
 - (b) instytucje emerytalne,
 - (c) instytucje inwestycyjne,
- 3.2.2 określając, które z podmiotów wchodzi w skład kategorii niemonetarnych instytucji finansowych, stosuje się kategorie zgodne z „Instrukcją uzupełniającą pakiet FINREP jednostkowy (FINPL)”, dostępną na stronie internetowej NBP, przy zachowaniu następujących zasad:
- (a) instytucje ubezpieczeniowe w rozumieniu Procedury odpowiadają następującej kategorii według klasyfikacji FINREP:
 - (i) I.2.1. Instytucje ubezpieczeniowe,
 - (b) instytucje emerytalne w rozumieniu Procedury odpowiadają następującej kategorii według klasyfikacji FINREP:
 - (i) I.2.2. Fundusze emerytalne,
 - (c) instytucje inwestycyjne w rozumieniu Procedury odpowiadają następującym kategoriom według klasyfikacji FINREP:
 - (i) I.1.2.2.2 Fundusze rynku pieniężnego,
 - (ii) I.2.3.1. Fundusze inwestycyjne (z wyłączeniem funduszy rynku pieniężnego),
- 3.3 Kategoria instytucji kredytowej na potrzeby Procedury:
- 3.3.1 obejmuje banki krajowe z uwzględnieniem banków zrzeszających, ale z wyłączeniem banków spółdzielczych oraz banków hipotecznych,
- 3.3.2 obejmuje oddziały banków zagranicznych oraz zagranicznych instytucji kredytowych, ale z wyłączeniem banków zagranicznych oraz zagranicznych instytucji kredytowych
- 3.3.3 nie obejmuje banków centralnych,
- 3.3.4 nie obejmuje spółdzielczych kas oszczędnościowo-kredytowych.
- 3.4 Kategoria bank zagraniczny obejmuje bank mający siedzibę na terytorium innego niż Rzeczypospolita Polska państwa. Kategoria zagranicznej instytucji kredytowej obejmuje podmioty mające siedzibę na terytorium innego niż Rzeczypospolita Polska państwa, których działalność polega na przyjmowaniu depozytów pieniężnych lub innych funduszy

podlegających zwrotowi od klientów oraz na udzielaniu kredytów na swój własny rachunek.

- 3.5 Kategoria instytucji kredytowej - łąro obejmuje banki zagraniczne oraz zagraniczne instytucje kredytowe, dla których Uczestnik Fixingu prowadzi rachunek pieniężny.
- 3.6 Kategoria instytucji finansowej - bank zagraniczny obejmuje banki zagraniczne oraz zagraniczne instytucje kredytowe, dla których Uczestnik Fixingu nie prowadzi rachunku pieniężnego.
- 3.7 Kategoria pozostałych niemonetarnych instytucji finansowych na potrzeby Procedury obejmuje podmioty należące do kategorii opisanej w punkcie „I.2. Pozostałe instytucje sektora finansowego” „Instrukcji uzupełniającej pakiet FINREP jednostkowy (FINPL)”, dostępnej na stronie internetowej NBP, z wyłączeniem podmiotów wskazanych w pkt 3.2 jako niemonetarne instytucje finansowe.
- 3.8 Kategoria przedsiębiorstw na potrzeby Procedury obejmuje podmioty należące do następujących kategorii opisanych w „Instrukcji uzupełniającej pakiet FINREP jednostkowy (FINPL)”, dostępnej na stronie internetowej NBP:
 - 3.8.1 II.1.1 MSP (Małe i średnie przedsiębiorstwa); oraz
 - 3.8.2 II.1.2 Duże przedsiębiorstwa.
- 3.9 Dane, o których mowa w pkt 3.1.1 - 3.1.3 będą przekazywane do godziny 16 następnego dnia roboczego następującego po dniu, w którym były zawarte transakcje (kwotowania) będące ich przedmiotem.
- 3.10 Dane, o których mowa w pkt 3.1.4 – 3.1.15 będą przekazywane do godziny 16 pierwszego dnia roboczego w tygodniu następującym po tygodniu, w którym były zawarte transakcje będące ich przedmiotem.
- 3.11 W przypadku wykrycia przez Uczestnika Fixingu błędu w przekazanych Danach 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.
- 3.12 Dla potrzeb przekazywania Danach klasyfikacja podmiotów jest dokonywana według stanu faktycznego z dnia przekazywania Danach.

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 w miarę możliwości wskazanie czy transakcja jest transakcją indywidualnie negocjowaną czy nienegocjowaną,
 - 4.3.9 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. 3.2.1 (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. 3.2.1 (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 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. 3.2.1 (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 stronę 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. 3.2.1 (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 w miarę możliwości wskazanie czy transakcja jest transakcją indywidualnie negocjowaną czy nienegocjowaną,
 - 4.7.9 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 Bank) 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 Banku (DEPO lub LOAN),
 - 4.8.5 kwotę transakcji,
 - 4.8.6 datę zapadalności transakcji,
 - 4.8.7 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.8.8 w miarę możliwości wskazanie czy transakcja jest transakcją indywidualnie negocjowaną czy nienegocjowaną,
 - 4.8.9 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 Bank) 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 Banku (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 Banku (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 Banku (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 Bank) i powinny zawierać:
- 4.12.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.12.2 datę waluty zawartej transakcji,
 - 4.12.3 stronę transakcji z punktu widzenia Banku (DEPO lub LOAN),
 - 4.12.4 kwotę transakcji,
 - 4.12.5 datę zapadalności transakcji,

- 4.12.6 stopę procentową dla transakcji,
 - 4.12.7 w miarę możliwości wskazanie czy transakcja jest transakcją indywidualnie negocjowaną czy nienegocjowaną,
 - 4.12.8 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),
 - 4.12.9 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 Bank) i powinny zawierać:
- 4.13.1 datę zawarcia transakcji,
 - 4.13.2 datę waluty transakcji,
 - 4.13.3 stronę transakcji z punktu widzenia Banku (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 w miarę możliwości wskazanie czy transakcja jest transakcją indywidualnie negocjowaną czy nienegocjowaną,
 - 4.13.9 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),
 - 4.13.10 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 można przyjąć godzinę wprowadzenia transakcji do systemu rejestracji tych transakcji przez Uczestnika Fixingu.
- 4.16 Szczegółowy zakres danych dotyczących zawartych transakcji, o których mowa powyżej, oraz sposób ich przekazywania będą uzgodnione z podmiotami przekazującymi dane i zaprezentowane w specyfikacji udostępnionej przez Administratora.

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 w zaszyfrowanych plikach za pomocą poczty elektronicznej.
- 5.3.2 poprzez serwer SFTP (Secure File Transfer Protocol) udostępniony przez Administratora za pośrednictwem dedykowanego modułu Systemu Fixingowego WIBIX po zakończeniu okresu testowego i wprowadzeniu zmian do Warunków Technicznych stanowiących załącznik do Kodeksu Postępowania

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 4.3.9, 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 4.3.9, 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 wymaga przeprowadzenia procedury zmiany 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.
- 7.4 Uczestnicy Fixingu, którzy ze względów technicznych nie są w stanie rozpocząć w dniu wejścia w życie zmienionej Procedury przekazywania Danych, o których mowa w pkt 3.1.5 - 3.1.8, w zakresie danych o transakcjach z podmiotami określonymi w pkt 3.5 i 3.6, mogą rozpocząć przekazywanie części lub wszystkich takich Danych w terminie późniejszym, jednak nie później niż w terminie 14 dni od dnia wejścia w życie zmienionej Procedury. Wraz z rozpoczęciem przekazywania brakujących Danych Uczestnik Fixingu przekazuje Dane historyczne za okres od dnia wejścia w życie zmienionej Procedury.