

INFORMACJA DOTYCZĄCA OGÓLNYCH WARUNKÓW ŚWIADCZENIA USŁUGI ROZLICZEŃ POŚREDNICH OFEROWANYCH PRZEZ DEPARTAMENT MAKLERSKI BANKU HANDLOWEGO („DMBH”)

1. WPROWADZENIE

DMBH świadczy usługi w zakresie rozliczeń pośrednich dla swych klientów w odniesieniu do derywatów znajdujących się w obrocie na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie SA („Usługi”), zgodnie z Rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2017/2154 z dnia 22 września 2017 roku uzupełniającym rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w zakresie ustaleń dotyczących rozliczeń pośrednich („RTS IC”).

2. RACHUNKI, MONITOROWANIE RYZYKA ORAZ PROCEDURY NA WYPADEK NIEWYKONANIA ZOBOWIĄZANIA

2.1 Rodzaje rachunków

2.1.1 Na podstawie pisemnego wniosku klienta DMBH świadczącego usługi w zakresie rozliczeń pośrednich dla swoich klientów pośrednich („Klient”) i odrębnej, pisemnej umowy zawartej między DMBH, a Klientem, oraz pod warunkiem spełnienia przez Klienta wszystkich ciężących na nim zobowiązań dotyczących oferowania rozliczeń pośrednich, DMBH otwiera i prowadzi dwa rodzaje rachunków w celu świadczenia Usług (w zależności od wniosku Klienta istnieje możliwość otwarcia jednego albo dwóch rachunków):

- (a) rachunek zbiorczy z aktywami i pozycjami utrzymywanymi przez tego Klienta na rachunek jego klientów pośrednich (tzw. „Rachunek OSA”);
- (b) rachunek zbiorczy z aktywami i pozycjami utrzymywanymi przez tego Klienta na rachunek jego klientów pośrednich, w przypadku którego DMBH zapewnia, by pozycje jednego klienta pośredniego nie były kompensowane pozycjami innego klienta pośredniego oraz by aktywa jednego klienta pośredniego nie mogły być wykorzystywane do pokrycia pozycji innego klienta pośredniego (tzw. „Rachunek GOSA”). W odniesieniu do Rachunków GOSA, DMBH przekazuje CCP codziennie wszystkie informacje niezbędne do tego, aby CCP był w stanie określić pozycje utrzymywane na rachunek każdego klienta pośredniego. W tym zakresie DMBH polega na zobowiązaniu Klienta do przekazywania DMBH wszelkich niezbędnych informacji. DMBH nie ma obowiązku przeprowadzać odrębnego badania, aby pozyskać informacje w tym zakresie. Zaleca się, aby klienci pośredni nałożyli konkretne zobowiązania w tym zakresie na swojego Klienta.

2.1.2 DMBH otworzy odpowiednie rachunki w CCP, jeżeli zostaną spełnione wymogi stawiane przez dany CCP w odniesieniu do Usług.

2.1.3 DMBH jest uczestnikiem rozliczającym w KDPW_CCP.

2.1.4 Aktywa i pozycje na Rachunku OSA i Rachunku GOSA nie będą łączone z aktywami i pozycjami Klienta posiadanymi na odrębnym rachunku.

2.2 Monitorowanie ryzyka

DMBH identyfikuje i monitoruje wszelkie istotne ryzyka wynikające ze świadczenia Usług, które mogą mieć wpływ na jego odporność na niekorzystne zmiany na rynku, oraz zarządza tymi ryzykami.

2.3 Proces zarządzania przypadkami niewykonania zobowiązań

- 2.3.1 W przypadku niewykonania zobowiązania przez Klienta, DMBH działa zgodnie z procedurami zarządzania przypadkiem niewykonania zobowiązania przez Klienta.
- 2.3.2 W przypadku niewykonania zobowiązania przez Klienta w odniesieniu do Rachunku OSA, DMBH ma prawo upłynnić aktywa i pozycje klientów pośrednich, w tym aktywa i pozycje na poziomie CCP, oraz obowiązek zwrócenia Klientowi, na rachunek klientów pośrednich, kwoty salda należnego z tytułu upłynnienia tych aktywów i pozycji.
- 2.3.3 W przypadku niewykonania zobowiązania przez Klienta w odniesieniu do Rachunku GOSA, DMBH ma prawo przenieść aktywa i pozycje, które są utrzymywane przez Klienta niewykonującego zobowiązania na rachunek jego klientów pośrednich, do innego klienta lub uczestnika rozliczającego, w terminie określonym w umowie pomiędzy danym klientem pośrednim, a Klientem, natomiast jeżeli przeniesienie aktywów i pozycji w tym terminie nie jest możliwe, bez względu na powód, DMBH ma prawo upłynnić aktywa i pozycje każdego klienta pośredniego oraz podjąć kroki mające na celu wypłatę każdemu klientowi pośredniemu przychodów z upłynnienia tych aktywów i pozycji. Jeżeli DMBH nie jest w stanie zidentyfikować klientów pośrednich lub dokonać wypłaty przychodów z upłynnienia aktywów na rzecz każdego klienta pośredniego, wówczas DMBH powinien zwrócić przychody z upłynnienia Klientowi, na rachunek jego klientów pośrednich. W tym zakresie DMBH polega na zobowiązaniu Klienta do przekazywania DMBH wszelkich niezbędnych informacji, jakie posiada na temat swoich klientów pośrednich, w przypadku niewykonania zobowiązań przez Klienta. DMBH nie ponosi odpowiedzialności za przeprowadzenie badania w celu pozyskania informacji pozwalających na ustalenie danych klientów pośrednich. Zaleca się, aby klienci pośredni nałożyli odpowiednie zobowiązania w tym zakresie na swojego Klienta w ramach własnych ustaleń z Klientami.
- 2.3.4 Aktywa i pozycje przechowywane na Rachunku GOSA lub Rachunku OSA nie powinny wejść w skład masy upadłościowej DMBH, w przypadku ogłoszenia upadłości DMBH. Zaleca się jednak każdemu Klientowi i klientowi pośredniemu uzyskanie odrębnej porady prawnej w tym zakresie.

3. MINIMALNE WYMOGI WOBEC KLIENTÓW

3.1 Wymogi ogólne

- 3.1.1 DMBH świadczy Usługi tylko na rzecz Klientów, którzy spełniają minimalne wymagania dotyczące zasobów finansowych i zdolności operacyjnych.
- 3.1.2 Klienci musi zapewnić, że posiadają wszystkie konieczne licencje i zgody konieczne do świadczenia usługi.

3.2 Minimalne wymagania dotyczące zasobów finansowych

Minimalne wymagania dotyczące zasobów finansowych obejmują: Klient powinien posiadać długoterminowy rating kredytowy wiarygodnej agencji ratingowej (Moody's Investors Service, Standard & Poor's, Fitch Ratings) nie niższy niż B. Jeśli rating jest niższy niż B albo Klient nie posiada takiego ratingu, DMBH analizuje ostatni rok współpracy z Klientem w kontekście rozliczania transakcji i uzupełniania depozytu rozliczeniowego w przypadku występowania debetu. Minimalne wymagania dotyczące zdolności operacyjnych

Minimalne wymagania dotyczące zdolności operacyjnych obejmują: potwierdzenie, że klient ma możliwość rozdzielania pozycji własnych od pozycji klientów, posiada możliwość rekonyliacji codziennych pozycji wynikających z obrotu derywatami, pokrywania debetów na zasadach ustalonych z DMBH oraz wypełnia obowiązki raportowe, w tym wynikające z EMIR i MIFID2.

4. OPŁATY

DMBH wprowadza opłaty z tytułu świadczenia Usług w zależności od rodzaju rachunku. Szczegółowe kwoty opłat są dostępne na żądanie Klienta lub potencjalnego klienta.

5. ODPOWIEDZIALNOŚĆ

DMBH nie ponosi odpowiedzialności za jakiegokolwiek straty, które mogą być poniesione przez Klientów lub klientów pośrednich, inne niż straty wynikające z winy umyślnej lub rażącego niedbalstwa DMBH., DMBH nie ponosi odpowiedzialności za utracone korzyści lub szkody, które nie wynikają bezpośrednio z danego zdarzenia.

6. PRAWO

Umowy z Klientami dotyczące rozliczeń i rozliczeń pośrednich podlegają prawu polskiemu.