**Załączniki do Regulaminu** **pełnienia funkcji**

**Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych z dnia 15 grudnia 2018 r.**

**Załącznik 1.1**

Transakcje bezwarunkowe zawarte na rynku wtórnym obligacji skarbowych\* (bez Rynku elektronicznego), na których został dokonany rozrachunek przez …*(nazwa DSPW lub Kandydata)*… w …*(miesiąc)*…

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data (rrrr-mm-dd)** | **ISIN SPW** | **kupno1) (szt.)** | **sprzedaż2) (szt.)** | **typ kontrpartnera3)** | **lokalizacja kontrpartnera4)** |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5-* | *-6-* |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

\* dotyczy wyłącznie obligacji skarbowych emitowanych na rynku krajowym

1. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną kupującą;
2. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną sprzedającą;
3. wstawić liczbę odpowiadającą jednemu z następujących typów:
1-DSPW,

2-bank (niebędący DSPW),

3-broker,
4-bank centralny,
5-instytucje publiczne (państwa, jednostki władz regionalnych lub lokalnych państwa oraz państwowe fundusze majątkowe),
6-zakłady ubezpieczeń,
7-fundusze emerytalne,
8-fundusze inwestycyjne (oraz równoznaczne instytucje na bazie prawa obcego np. asset managers, fund managers, mutual funds),
9-fundusze hedgingowe,
10-osoby fizyczne,
11-podmioty niefinansowe,
12-inne podmioty;

1. oznaczyć kraj według kodu ISO 3166-1 alpha-3 (dopuszczalny kod ISO 3166-1 alpha-2) lub, wyłącznie
w przypadku wstawienia w kolumnie 5 wartości 4 („bank centralny”), według kodu określonego w zał. 1.4 jednego z następujących regionów geograficznych:

AAA-Afryka,

BBB-Ameryka Południowa (w tym Karaiby),

CCC-Ameryka Północna,

DDD-Australia i Oceania,

EEE-Azja (bez Bliskiego Wschodu),

FFF-Bliski Wschód,

GGG-Europa - kraje strefy euro,

HHH-Europa - kraje UE spoza strefy euro,

JJJ-Europa - kraje spoza UE.

Uwaga: Tabelę sporządza DSPW/Kandydat (bezpośrednio lub za pośrednictwem uczestnika ds. rozrachunku)
i przekazuje w formie arkusza kalkulacyjnego.

**Załącznik 1.2**

Transakcje bezwarunkowe zawarte na rynku wtórnym bonów skarbowych (bez Rynku elektronicznego), na których został dokonany rozrachunek przez …*(nazwa DSPW lub Kandydata)…* w …*(miesiąc)*…

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data (rrrr-mm-dd)** | **ISIN SPW** | **kupno1) (szt.)** | **sprzedaż2) (szt.)** | **typ kontrpartnera3)** | **lokalizacja kontrpartnera4)** |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5-* | *-6-* |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

1. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną kupującą;
2. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną sprzedającą;
3. wstawić liczbę odpowiadającą jednemu z następujących typów:
1-DSPW,

2-bank (niebędący DSPW),

3-broker,
4-bank centralny,
5-instytucje publiczne (państwa, jednostki władz regionalnych lub lokalnych państwa oraz państwowe fundusze majątkowe),
6-zakłady ubezpieczeń,
7-fundusze emerytalne,
8-fundusze inwestycyjne (oraz równoznaczne instytucje na bazie prawa obcego np. asset managers, fund managers, mutual funds),
9-fundusze hedgingowe,
10-osoby fizyczne,
11-podmioty niefinansowe,
12-inne podmioty;

1. oznaczyć kraj według kodu ISO 3166-1 alpha-3 (dopuszczalny kod ISO 3166-1 alpha-2) lub, wyłącznie
w przypadku wstawienia w kolumnie 5 wartości 4 („bank centralny”), według kodu określonego w zał. 1.4 jednego z następujących regionów geograficznych:

AAA-Afryka,

BBB-Ameryka Południowa (w tym Karaiby),

CCC-Ameryka Północna,

DDD-Australia i Oceania,

EEE-Azja (bez Bliskiego Wschodu),

FFF-Bliski Wschód,

GGG-Europa - kraje strefy euro,

HHH-Europa - kraje UE spoza strefy euro,

JJJ-Europa - kraje spoza UE.

Uwaga: Tabelę sporządza DSPW/Kandydat (bezpośrednio lub za pośrednictwem uczestnika ds. rozrachunku)
i przekazuje w formie arkusza kalkulacyjnego.

**Załącznik 1.3**

Transakcje bezwarunkowe zawarte na rynku wtórnym obligacji zagranicznych (bez Rynku elektronicznego) rozliczone przez …*(nazwa DSPW lub Kandydata)*… w …*(miesiąc)*…

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data (rrrr-mm-dd)** | **ISIN obligacji** | **kupno1) (szt.)** | **sprzedaż2) (szt.)** | **typ kontrpartnera3)** | **lokalizacja kontrpartnera4)** |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5-* | *-6-* |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

1. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną kupującą;
2. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną sprzedającą;
3. wstawić liczbę odpowiadającą jednemu z następujących typów:
1-DSPW,

2-bank (niebędący DSPW),

3-broker,
4-bank centralny,
5-instytucje publiczne (państwa, jednostki władz regionalnych lub lokalnych państwa oraz państwowe fundusze majątkowe),
6-zakłady ubezpieczeń,
7-fundusze emerytalne,
8-fundusze inwestycyjne (oraz równoznaczne instytucje na bazie prawa obcego np. asset managers, fund managers, mutual funds),
9-fundusze hedgingowe,
10-osoby fizyczne,
11-podmioty niefinansowe,
12-inne podmioty;

1. oznaczyć kraj według kodu ISO 3166-1 alpha-3 (dopuszczalny kod ISO 3166-1 alpha-2) lub, wyłącznie
w przypadku wstawienia w kolumnie 5 wartości 4 („bank centralny”), według kodu określonego w zał. 1.4 jednego z następujących regionów geograficznych:

AAA-Afryka,

BBB-Ameryka Południowa (w tym Karaiby),

CCC-Ameryka Północna,

DDD-Australia i Oceania,

EEE-Azja (bez Bliskiego Wschodu),

FFF-Bliski Wschód,

GGG-Europa - kraje strefy euro,

HHH-Europa - kraje UE spoza strefy euro,

JJJ-Europa - kraje spoza UE.

Uwaga: Tabelę sporządza DSPW/Kandydat (bezpośrednio lub za pośrednictwem uczestnika ds. rozrachunku)
i przekazuje w formie arkusza kalkulacyjnego.

**Załącznik 1.4**

**Klasyfikacja krajów według regionów geograficznych:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Polska nazwa skrócona** | **ISO3166-1 Alpha-2** | **ISO3166-1 Alpha-3** | **Region geograficzny** | **Kod regionu**  |
| Afganistan | AF | AFG | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Albania | AL | ALB | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Algieria | DZ | DZA | Afryka | AAA |
| Andora | AD | AND | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Angola | AO | AGO | Afryka | AAA |
| Anguilla | AI | AIA | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Antarktyda | AQ | ATA | (\*) |  |
| Antigua i Barbuda | AG | ATG | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Arabia Saudyjska | SA | SAU | Bliski Wschód | FFF |
| Argentyna | AR | ARG | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Armenia | AM | ARM | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Aruba | AW | ABW | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Australia | AU | AUS | Australia i Oceania | DDD |
| Austria | AT | AUT | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Azerbejdżan | AZ | AZE | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Bahamy | BS | BHS | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Bahrajn | BH | BHR | Bliski Wschód | FFF |
| Bangladesz | BD | BGD | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Barbados | BB | BRB | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Belgia | BE | BEL | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Belize | BZ | BLZ | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Benin | BJ | BEN | Afryka | AAA |
| Bermudy | BM | BMU | Ameryka Północna | CCC |
| Bhutan | BT | BTN | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Białoruś | BY | BLR | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Boliwia | BO | BOL | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Bonaire | BQ | BES | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Bośnia i Hercegowina | BA | BIH | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Botswana | BW | BWA | Afryka | AAA |
| Brazylia | BR | BRA | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Brunei | BN | BRN | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Brytyjskie Terytorium Oceanu Indyjskiego | IO | IOT | (\*) |  |
| Brytyjskie Wyspy Dziewicze | VG | VGB | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Bułgaria | BG | BGR | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Burkina Faso | BF | BFA | Afryka | AAA |
| Burundi | BI | BDI | Afryka | AAA |
| Chile | CL | CHL | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Chiny | CN | CHN | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Chorwacja | HR | HRV | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Curacao | CW | CUW | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Cypr | CY | CYP | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Czarnogóra | ME | MNE | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Dalekie Wyspy Mniejsze Stanów Zjednoczonych | UM | UMI | Ameryka Północna | CCC |
| Dania | DK | DNK | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Demokratyczna Republika Konga | CD | COD | Afryka | AAA |
| Dominika | DM | DMA | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Dominikana | DO | DOM | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Dżibuti | DJ | DJI | Afryka | AAA |
| Egipt | EG | EGY | Afryka | AAA |
| Ekwador | EC | ECU | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Erytrea | ER | ERI | Afryka | AAA |
| Estonia | EE | EST | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Etiopia | ET | ETH | Afryka | AAA |
| Falklandy | FK | FLK | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Fidżi | FJ | FJI | Australia i Oceania | DDD |
| Filipiny | PH | PHL | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Finlandia | FI | FIN | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Francja | FR | FRA | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Francuskie Terytoria Południowe i Antarktyczne | TF | ATF | (\*) |  |
| Gabon | GA | GAB | Afryka | AAA |
| Gambia | GM | GMB | Afryka | AAA |
| Georgia Południowa i Sandwich Południowy | GS | SGS | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Ghana | GH | GHA | Afryka | AAA |
| Gibraltar | GI | GIB | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Grecja | GR | GRC | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Grenada | GD | GRD | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Grenlandia | GL | GRL | Ameryka Północna | CCC |
| Gruzja | GE | GEO | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Guam | GU | GUM | Australia i Oceania | DDD |
| Guernsey | GG | GGY | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Gujana  | GY | GUY | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Gujana Francuska | GF | GUF | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Gwadelupa | GP | GLP | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Gwatemala | GT | GTM | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Gwinea | GN | GIN | Afryka | AAA |
| Gwinea - Bissau | GW | GNB | Afryka | AAA |
| Gwinea Równikowa | GQ | GNQ | Afryka | AAA |
| Haiti | HT | HTI | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Hiszpania | ES | ESP | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Holandia | NL | NLD | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Honduras | HN | HND | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Hong Kong | HK | HKG | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Indie | IN | IND | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Indonezja | ID | IDN | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Irak | IQ | IRQ | Bliski Wschód | FFF |
| Iran | IR | IRN | Bliski Wschód | FFF |
| Irlandia | IE | IRL | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Islandia | IS | ISL | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Izrael | IL | ISR | Bliski Wschód | FFF |
| Jamajka | JM | JAM | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Japonia | JP | JPN | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Jemen | YE | YEM | Bliski Wschód | FFF |
| Jersey | JE | JEY | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Jordania | JO | JOR | Bliski Wschód | FFF |
| Kajmany | KY | CYM | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Kambodża | KH | KHM | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Kamerun | CM | CMR | Afryka | AAA |
| Kanada | CA | CAN | Ameryka Północna | CCC |
| Katar | QA | QAT | Bliski Wschód | FFF |
| Kazachstan | KZ | KAZ | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Kenia | KE | KEN | Afryka | AAA |
| Kirgistan | KG | KGZ | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Kiribati | KI | KIR | Australia i Oceania | DDD |
| Kolumbia | CO | COL | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Komory | KM | COM | Afryka | AAA |
| Korea Południowa | KR | KOR | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Korea Północna | KP | PRK | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Kostaryka | CR | CRI | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Kuba | CU | CUB | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Kuwejt | KW | KWT | Bliski Wschód | FFF |
| Laos | LA | LAO | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Lesotho | LS | LSO | Afryka | AAA |
| Liban | LB | LBN | Bliski Wschód | FFF |
| Liberia | LR | LBR | Afryka | AAA |
| Libia | LY | LBY | Afryka | AAA |
| Liechtenstein | LI | LIE | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Litwa | LT | LTU | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Luksemburg | LU | LUX | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Łotwa | LV | LVA | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Macedonia | MK | MKD | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Madagaskar | MG | MDG | Afryka | AAA |
| Majotta | YT | MYT | Afryka | AAA |
| Makau | MO | MAC | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Malawi | MW | MWI | Afryka | AAA |
| Malediwy | MV | MDV | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Malezja | MY | MYS | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Mali | ML | MLI | Afryka | AAA |
| Malta | MT | MLT | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Mariany Północne | MP | MNP | Australia i Oceania | DDD |
| Maroko | MA | MAR | Afryka | AAA |
| Martynika | MQ | MTQ | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Mauretania | MR | MRT | Afryka | AAA |
| Mauritius | MU | MUS | Afryka | AAA |
| Meksyk | MX | MEX | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Mikronezja | FM | FSM | Australia i Oceania | DDD |
| Mjanma | MM | MMR | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Mołdawia | MD | MDA | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Monako | MC | MCO | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Mongolia | MN | MNG | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Montserrat | MS | MSR |  Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Mozambik | MZ | MOZ | Afryka | AAA |
| Namibia | NA | NAM | Afryka | AAA |
| Nauru | NR | NRU | Australia i Oceania | DDD |
| Nepal | NP | NPL | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Niemcy | DE | DEU | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Niger | NE | NER | Afryka | AAA |
| Nigeria | NG | NGA | Afryka | AAA |
| Nikaragua | NI | NIC | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Niue | NU | NIU | Australia i Oceania | DDD |
| Norfolk  | NF | NFK | Australia i Oceania | DDD |
| Norwegia | NO | NOR | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Nowa Kaledonia | NC | NCL | Australia i Oceania | DDD |
| Nowa Zelandia | NZ | NZL | Australia i Oceania | DDD |
| Oman | OM | OMN | Bliski Wschód | FFF |
| Pakistan | PK | PAK | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Palau | PW | PLW | Australia i Oceania | DDD |
| Palestyna | PS | PSE | Bliski Wschód | FFF |
| Panama | PA | PAN | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Papua Nowa Gwinea | PG | PNG | Australia i Oceania | DDD |
| Paragwaj | PY | PRY | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Peru | PE | PER | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Pitcairn  | PN | PCN | Australia i Oceania | DDD |
| Polinezja Francuska | PF | PYF | Australia i Oceania | DDD |
| Polska | PL | POL | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Portoryko | PR | PRI | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Portugalia | PT | PRT | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Republika Czadu | TD | TCD | Afryka | AAA |
| Republika Czeska | CZ | CZE | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Republika Konga | CG | COG | Afryka | AAA |
| Republika Południowej Afryki | ZA | ZAF | Afryka | AAA |
| Republika Środkowoafrykańska | CF | CAF | Afryka | AAA |
| Republika Zielonego Przylądka | CV | CPV | Afryka | AAA |
| Reunion | RE | REU | Afryka | AAA |
| Rosja | RU | RUS | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Rumunia | RO | ROU | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Rwanda | RW | RWA | Afryka | AAA |
| Sahara Zachodnia | EH | ESH | Afryka | AAA |
| Saint Kitts i Nevis | KN | KNA | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Saint Lucia | LC | LCA | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Saint Martin | MF | MAF | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Saint Vincent i Grenadyny | VC | VCT | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Saint-Barthélemy | BL | BLM | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Saint-Pierre i Miquelon | PM | SPM | Ameryka Północna | CCC |
| Salwador | SV | SLV | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Samoa | WS | WSM | Australia i Oceania | DDD |
| Samoa Amerykańskie | AS | ASM | Australia i Oceania | DDD |
| San Marino | SM | SMR | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Senegal | SN | SEN | Afryka | AAA |
| Serbia | RS | SRB | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Seszele | SC | SYC | Afryka | AAA |
| Sierra Leone | SL | SLE | Afryka | AAA |
| Singapur | SG | SGP | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Sint Maarten | SX | SXM | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Słowacja | SK | SVK | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Słowenia | SI | SVN | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Somalia | SO | SOM | Afryka | AAA |
| Sri Lanka | LK | LKA | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Stany Zjednoczone | US | USA | Ameryka Północna | CCC |
| Suazi | SZ | SWZ | Afryka | AAA |
| Sudan | SD | SDN | Afryka | AAA |
| Sudan Południowy | SS | SSD | Afryka | AAA |
| Surinam | SR | SUR | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Svalbard i Jan Mayen | SJ | SJM | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Syria | SY | SYR | Bliski Wschód | FFF |
| Szwajcaria | CH | CHE | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Szwecja | SE | SWE | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Tadżykistan | TJ | TJK | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Tajlandia | TH | THA | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Tajwan | TW | TWN | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Tanzania | TZ | TZA | Afryka | AAA |
| Timor Wschodni | TL | TLS | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Togo | TG | TGO | Afryka | AAA |
| Tokelau | TK | TKL | Australia i Oceania | DDD |
| Tonga | TO | TON | Australia i Oceania | DDD |
| Trynidad i Tobago | TT | TTO | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Tunezja | TN | TUN | Afryka | AAA |
| Turcja | TR | TUR | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Turkmenistan | TM | TKM | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Tuvalu | TV | TUV | Australia i Oceania | DDD |
| Uganda | UG | UGA | Afryka | AAA |
| Ukraina | UA | UKR | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Urugwaj | UY | URY | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Uzbekistan | UZ | UZB | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Vanuatu | VU | VUT | Australia i Oceania | DDD |
| Wallis i Futuna | WF | WLF | Australia i Oceania | DDD |
| Watykan | VA | VAT | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Wenezuela | VE | VEN | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Węgry | HU | HUN | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Wielka Brytania | GB | GBR | Europa - kraje UE spoza strefy euro | HHH |
| Wietnam | VN | VNM | Azja (bez Bliskiego Wschodu) | EEE |
| Włochy | IT | ITA | Europa - kraje strefy euro | GGG |
| Wybrzeże Kości Słoniowej | CI | CIV | Afryka | AAA |
| Wyspa Bouveta | BV | BVT | (\*) |  |
| Wyspa Bożego Narodzenia | CX | CXR | Australia i Oceania | DDD |
| Wyspa Man | IM | IMN | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Wyspa Świętej Heleny | SH | SHN | Afryka | AAA |
| Wyspy Alandzkie | AX | ALA | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Wyspy Cooka | CK | COK | Australia i Oceania | DDD |
| Wyspy Dziewicze Stanów Zjednoczonych | VI | VIR | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Wyspy Heard i McDonalda | HM | HMD | (\*) |  |
| Wyspy Kokosowe | CC | CCK | Australia i Oceania | DDD |
| Wyspy Marshalla | MH | MHL | Australia i Oceania | DDD |
| Wyspy Owcze | FO | FRO | Europa - kraje spoza UE | JJJ |
| Wyspy Salomona | SB | SLB | Australia i Oceania | DDD |
| Wyspy Świętego Tomasza i Książęca | ST | STP | Afryka | AAA |
| Wyspy Turks i Caicos | TC | TCA | Ameryka Południowa (w tym Karaiby) | BBB |
| Zambia | ZM | ZMB | Afryka | AAA |
| Zimbabwe | ZW | ZWE | Afryka | AAA |
| Zjednoczone Emiraty Arabskie | AE | ARE | Bliski Wschód | FFF |

(\*) terytoria bez stałych mieszkańców

**Załącznik 1.5**

Badanie ankietowe postrzeganej przez DSPW lub Kandydata płynności poszczególnych obligacji skarbowych\* sporządzone przez …(*nazwa DSPW lub Kandydata*)… w okresie1) …

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **data (rrrr-mm-dd)** | **ISIN obligacji skarbowych2)**  | **maksymalna kwota pojedynczej transakcji sprzedaży obligacji możliwa w ocenie DPSW lub Kandydata do zrealizowania w bieżących warunkach rynkowych nie wpływająca na zmianę ceny obligacji3)(mln zł)** | **szacowana przez DSPW lub Kandydata zamiana ceny obligacji na skutek realizacji pojedynczego zlecenia sprzedaży w kwocie określonej w kolumnie nr 53)(pb)** | **kwota pojedynczego zlecenia sprzedaży4)****(mln zł)** |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5--* |
| emisje bazowe |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| emisje niebazowe podlegające fixingowi |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

\* dotyczy wyłącznie obligacji skarbowych emitowanych na rynku krajowym

1. dotyczy średniej sytuacji rynkowej w danym dniu roboczym/tygodniu roboczym – okres wskazywany każdorazowo w przekazywanej ankiecie;
2. obowiązująca w danym dniu lista obligacji skarbowych podlegających fixingowi – obowiązkowe wypełnienie ankiety co najmniej w odniesieniu do emisji bazowych;
3. wypełnić lub pozostawić puste w przypadku braku opinii odnośnie danej serii obligacji skarbowych;
4. kwota określana każdorazowo w przekazywanej w ankiecie.

Uwaga: Informacje przedstawione w tabeli nie stanowią oferty kupna/sprzedaży danego SPW, a odzwierciedlają jedynie najlepszą wiedzę DSPW/Kandydata o sytuacji rynkowej w danym czasie.

**Załącznik 1.6**

Transakcje bezwarunkowe zawarte na rynku wtórnym obligacji skarbowych\* (bez Rynku elektronicznego), na których został dokonany rozrachunek przez:

*-* …*(nazwa DSPW lub Kandydata)…,*

*- …(nazwa podmiotu z grupy bankowej, w skład której wchodzi DSPW lub Kandydat)…,*
- *…(nazwa podmiotu z grupy bankowej, w skład której wchodzi DSPW lub Kandydat)…*

w …*(miesiąc)*…

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data (rrrr-mm-dd)** | **ISIN SPW** | **kupno1) (szt.)** | **sprzedaż2) (szt.)** | **typ kontrpartnera3)** | **lokalizacja kontrpartnera4)** |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5-* | *-6-* |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

\* dotyczy wyłącznie obligacji skarbowych emitowanych na rynku krajowym

1. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną kupującą;
2. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną sprzedającą;
3. wstawić liczbę odpowiadającą jednemu z następujących typów:
1-DSPW,

2-bank (niebędący DSPW),

3-broker,
4-bank centralny,
5-instytucje publiczne (państwa, jednostki władz regionalnych lub lokalnych państwa oraz państwowe fundusze majątkowe),
6-zakłady ubezpieczeń,
7-fundusze emerytalne,
8-fundusze inwestycyjne (oraz równoznaczne instytucje na bazie prawa obcego np. asset managers, fund managers, mutual funds),
9-fundusze hedgingowe,
10-osoby fizyczne,
11-podmioty niefinansowe,
12-inne podmioty;

1. oznaczyć kraj według kodu ISO 3166-1 alpha-3 (dopuszczalny kod ISO 3166-1 alpha-2) lub, wyłącznie
w przypadku wstawienia w kolumnie 5 wartości 4 („bank centralny”), według kodu określonego w zał. 1.4 jednego z następujących regionów geograficznych:

AAA-Afryka,

BBB-Ameryka Południowa (w tym Karaiby),

CCC-Ameryka Północna,

DDD-Australia i Oceania,

EEE-Azja (bez Bliskiego Wschodu),

FFF-Bliski Wschód,

GGG-Europa - kraje strefy euro,

HHH-Europa - kraje UE spoza strefy euro,

JJJ-Europa - kraje spoza UE.

Uwaga: Tabelę sporządza DSPW/Kandydat i przekazuje w formie arkusza kalkulacyjnego.

**Załącznik 1.7**

Transakcje bezwarunkowe zawarte na rynku wtórnym bonów skarbowych (bez Rynku elektronicznego), na których został dokonany rozrachunek przez:

*-* …*(nazwa DSPW lub Kandydata)…,*

*- …(nazwa podmiotu z grupy bankowej, w skład której wchodzi DSPW lub Kandydat)…,*
- *…(nazwa podmiotu z grupy bankowej, w skład której wchodzi DSPW lub Kandydat)…*

w …*(miesiąc)*…

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data (rrrr-mm-dd)** | **ISIN SPW** | **kupno1) (szt.)** | **sprzedaż2) (szt.)** | **typ kontrpartnera3)** | **lokalizacja kontrpartnera4)** |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5-* | *-6-* |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

1. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną kupującą;
2. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną sprzedającą;
3. wstawić liczbę odpowiadającą jednemu z następujących typów:
1-DSPW,

2-bank (niebędący DSPW),

3-broker,
4-bank centralny,
5-instytucje publiczne (państwa, jednostki władz regionalnych lub lokalnych państwa oraz państwowe fundusze majątkowe),
6-zakłady ubezpieczeń,
7-fundusze emerytalne,
8-fundusze inwestycyjne (oraz równoznaczne instytucje na bazie prawa obcego np. asset managers, fund managers, mutual funds),
9-fundusze hedgingowe,
10-osoby fizyczne,
11-podmioty niefinansowe,
12-inne podmioty;

1. oznaczyć kraj według kodu ISO 3166-1 alpha-3 (dopuszczalny kod ISO 3166-1 alpha-2) lub, wyłącznie
w przypadku wstawienia w kolumnie 5 wartości 4 („bank centralny”), według kodu określonego w zał. 1.4 jednego z następujących regionów geograficznych:

AAA-Afryka,

BBB-Ameryka Południowa (w tym Karaiby),

CCC-Ameryka Północna,

DDD-Australia i Oceania,

EEE-Azja (bez Bliskiego Wschodu),

FFF-Bliski Wschód,

GGG-Europa - kraje strefy euro,

HHH-Europa - kraje UE spoza strefy euro,

JJJ-Europa - kraje spoza UE.

Uwaga: Tabelę sporządza DSPW/Kandydat i przekazuje w formie arkusza kalkulacyjnego.

**Załącznik 1.8**

Transakcje bezwarunkowe zawarte na rynku wtórnym obligacji zagranicznych (bez Rynku elektronicznego), na których został dokonany rozrachunek przez:

*-* …*(nazwa DSPW lub Kandydata)…,*

*- …(nazwa podmiotu z grupy bankowej, w skład której wchodzi DSPW lub Kandydat)…,*
- *…(nazwa podmiotu z grupy bankowej, w skład której wchodzi DSPW lub Kandydat)…*

w …*(miesiąc)*…

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data (rrrr-mm-dd)** | **ISIN obligacji** | **kupno1) (szt.)** | **sprzedaż2) (szt.)** | **typ kontrpartnera3)** | **lokalizacja kontrpartnera4)** |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5-* | *-6-* |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

1. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną kupującą;
2. wypełnić, jeśli podmiot (DSPW lub Kandydat) był w transakcji stroną sprzedającą;
3. wstawić liczbę odpowiadającą jednemu z następujących typów:
1-DSPW,

2-bank (niebędący DSPW),

3-broker,
4-bank centralny,
5-instytucje publiczne (państwa, jednostki władz regionalnych lub lokalnych państwa oraz państwowe fundusze majątkowe),
6-zakłady ubezpieczeń,
7-fundusze emerytalne,
8-fundusze inwestycyjne (oraz równoznaczne instytucje na bazie prawa obcego np. asset managers, fund managers, mutual funds),
9-fundusze hedgingowe,
10-osoby fizyczne,
11-podmioty niefinansowe,
12-inne podmioty;

1. oznaczyć kraj według kodu ISO 3166-1 alpha-3 (dopuszczalny kod ISO 3166-1 alpha-2) lub, wyłącznie
w przypadku wstawienia w kolumnie 5 wartości 4 („bank centralny”), według kodu określonego w zał. 1.4 jednego z następujących regionów geograficznych:

AAA-Afryka,

BBB-Ameryka Południowa (w tym Karaiby),

CCC-Ameryka Północna,

DDD-Australia i Oceania,

EEE-Azja (bez Bliskiego Wschodu),

FFF-Bliski Wschód,

GGG-Europa - kraje strefy euro,

HHH-Europa - kraje UE spoza strefy euro,

JJJ-Europa - kraje spoza UE.

Uwaga: Tabelę sporządza DSPW/Kandydat i przekazuje w formie arkusza kalkulacyjnego.

**Załącznik 2**

*(pieczęć firmowa podmiotu)*

### OŚWIADCZENIE

Niniejszym przekazujemy listę osób z …*(nazwa DSPW lub Kandydata)…* upoważnionych do kontaktów z przedstawicielami Ministra w ramach uczestnictwa w systemie Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych lub postępowania przygotowawczego:

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | Imię | Nazwisko | Stanowisko | Telefon | E-mail | Inne\**(tak/nie)* |
| 1 |  |  |  |  |  |  |
| 2 |  |  |  |  |  |  |
| 3 |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |
| ... |  |  |  |  |  |  |

(\*) Osoby upoważnione do kontaktów z przedstawicielami Ministra w sprawie bieżącej sytuacji rynkowej (kontakt przed przetargami SPW). Kolumnę wypełnia tylko DSPW.

Jednocześnie zobowiązujemy się do poinformowania wskazanych wyżej osób, że dane ich zostały udostępnione Ministrowi w związku z postępowaniem przygotowawczym oraz uczestniczeniem w systemie Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych oraz że:

1. Minister jako administrator danych zapewnia kontakt z Inspektorem Ochrony Danych
w Ministerstwie Finansów za pośrednictwem adresu poczty elektronicznej: iod@mf.gov.pl;
2. przysługuje im prawo żądania dostępu do własnych danych osobowych, sprostowania, usunięcia lub ograniczenia przetwarzania, a także prawo do przenoszenia danych i prawo wniesienia sprzeciwu wobec przetwarzania własnych danych osobowych;
3. przysługuje im prawo do wniesienia skargi do Prezesa Urzędu Ochrony Danych Osobowych;
4. podanie danych osobowych jest niezbędne do realizacji celu, o którym mowa wyżej;
5. dane osobowe będą przechowywane przez okres niezbędny do realizacji celów przetwarzania, lecz nie krócej niż okres wskazany w przepisach o archiwizacji;
6. dane ich nie będą wykorzystywane do podejmowania zautomatyzowanych decyzji
w indywidualnych przypadkach, w tym do profilowania;
7. dane ich mogą być udostępnione NBP do realizacji celu, o którym mowa wyżej.

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

**Załącznik 3**

*(pieczęć firmowa podmiotu)*

### OŚWIADCZENIE

Stosownie do postanowień § 13 Regulaminu pełnienia funkcji Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych oświadczamy, że:

1. według stanu na koniec poprzedniego roku kalendarzowego posiadaliśmy:
2. rating kredytowy na poziomie: ………………,
3. fundusze własne na poziomie: ………………;
4. wartość naszego portfela SPW wynosiła:
5. według stanu na koniec poprzedniego roku **–** ……………… mln zł,
6. według stanu na koniec roku poprzedzającego rok, o którym mowa w lit. a **–** ……………… mln zł;
7. pełnimy funkcję dealera skarbowych (rządowych) papierów wartościowych
w następujących krajach członkowskich OECD[[1]](#footnote-1): ………………,
8. zobowiązujemy się do każdorazowego informowania Ministra o zmianie ratingu kredytowego.

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

**Załącznik 4**

*(pieczęć firmowa podmiotu)*

### OŚWIADCZENIE

Niniejszym informujemy, że uczestnikiem ds. rozrachunku, za pośrednictwem którego prowadzony jest rozrachunek zawieranych przez nas transakcji z wykorzystaniem polskich SPW jest:

…*(nazwa uczestnika ds. rozrachunku)*…

Jednocześnie wyrażamy zgodę na przekazywanie Ministrowi przez uczestnika
ds. rozrachunku danych dotyczących aktywności naszego podmiotu na rynku finansowym
w zakresie niezbędnym do oceny w ramach systemu Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych oraz na kontrolę i weryfikację tych danych przez Ministra.

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

**Załącznik 5**

*(pieczęć firmowa uczestnika rozliczającego)*

OŚWIADCZENIE

Niniejszym oświadczamy, że:

…*(nazwa uczestnika ds. rozrachunku)*…

jest uczestnikiem ds. rozrachunku w zakresie transakcji zawartych na SPW przez:

…*(nazwa podmiotu)*… .

### Ponadto wyrażamy zgodę na dokonywanie przez przedstawicieli Ministra w naszej siedzibie kontroli i weryfikacji danych przekazywanych Ministrowi w związku z uczestnictwem w systemie Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych podmiotu, na rzecz którego dokonywany jest rozrachunek.

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

**Załącznik 6**

 *(pieczęć firmowa podmiotu)*

### DEKLARACJA

Niniejszym deklarujemy zamiar uczestnictwa w systemie Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych (DSPW).

W związku z tym zobowiązujemy się do realizacji postanowień Regulaminu pełnienia funkcji DSPW („Regulamin”) oraz do przekazywania Ministrowi, bezpośrednio lub za pośrednictwem uczestnika
ds. rozrachunku, informacji, o których mowa w Regulaminie.

Jednocześnie wyrażamy zgodę na:

1) udostępnianie przez NBP oraz podmiot prowadzący Rynek elektroniczny Ministrowi lub osobom przez niego upoważnionym danych dotyczących transakcji zawartych na SPW;

2) udostępnianie przez NBP Ministrowi lub osobom przez niego upoważnionym danych służących do oceny naszej wiarygodności kredytowej[[2]](#footnote-2);

3) kontrolowanie przez upoważnionych przedstawicieli Ministra realizacji postanowień Regulaminu oraz rzetelności sprawozdań, o których w nim mowa.

Upoważniamy Ministra oraz osoby przez niego upoważnione doweryfikacji w miejscu prowadzenia działalności podmiotu informacji i danych przekazywanych Ministrowi w związku z uczestnictwem
w systemie DSPW. W tym celu zobowiązujemy się udostępniać wszelkie informacje niezbędne dla przeprowadzenia tej weryfikacji. Niezależnie od tego upoważniamy Ministra oraz osoby przez niego upoważnione do podejmowania innych, uznanych za niezbędne, czynności weryfikacyjno**-**kontrolnych dotyczących naszych działań w zakresie związanym z uczestnictwem w systemie DSPW.

Wyrażamy zgodę na dokonywanie przez Ministra lub osoby przez niego upoważnione oceny realizacji przez nas postanowień wyżej wymienionych przepisów oraz na przyjęcie ocen okresowych określonych w Regulaminie.

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

**Załącznik 7.1**

Transakcje bezwarunkowe zawarte na Rynku elektronicznym …*(data)*…

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data** | **ISIN SPW** | **wolumen (szt.)** | **cena** | **Wartość(tys. zł)** | **kupujący** | **sprzedający** | **agresor\*** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |

\* Strona inicjująca transakcję.

Uwaga: Tabelę sporządza Podmiot prowadzący Rynek elektroniczny.

**Załącznik 7.2**

Transakcje warunkowe zawarte na Rynku elektronicznym …*(data)*…

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **data** | **ISIN SPW** | **wolumen (szt.)** | **data rozliczenia otwarcia** | **data rozliczenia zamknięcia** | **cena otwarcia** | **cena zamknięcia** | **kupujący** | **sprzedający** | **agresor\*** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

\* Strona inicjująca transakcję.

Uwaga: Tabelę sporządza Podmiot prowadzący Rynek elektroniczny.

**Załącznik 7.3**

Udział Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych w sesji fixingowej …*(data)*…

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **nazwa DSPW** | **liczba ofert kupna** | **liczba ofert sprzedaży** | **liczba kwotowanych SPW** |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

Uwaga: Tabelę sporządza Podmiot prowadzący Rynek elektroniczny.

**Załącznik 7.4**

Wyniki sesji fixingowej …*(data)*…

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ISIN SPW** | **liczba ofert kupna** | **liczba ofert sprzedaży** | **cena kupna** | **cena sprzedaży** | **rentowność kupna** | **rentowność sprzedaży** | **fixing** | **liczba DSPW kwotujących** |
| **cena** | **rentowność** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

Uwaga: Tabelę sporządza Podmiot prowadzący Rynek elektroniczny.

**Załącznik 7.5**

Informacja o kwotowaniach Dealerów Skarbowych Papierów Wartościowych, o których mowa w § 5 Regulaminu pełnienia funkcji Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych w dniu ........... *(data)* ........

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DSPW lub kandydat** | **ISIN SPW** | **czas kwotowania\*****(hh:mm:ss)** | **średni spread\*****(pb)** | **średnia wartość\*****(mln zł)** | **maksymalny****wymagany spread****(pb)** | **minimalna wymagana wartość (mln zł)** |
| podmiot1 | PL00001aaaaaa |  |  |  |  |  |
| podmiot1 | PL00001bbbbbb |  |  |  |  |  |
| podmiot1 | PL00001cccccc |  |  |  |  |  |
| ... | ... |  |  |  |  |  |
| podmiot2 | PL00001aaaaaa |  |  |  |  |  |
| podmiot2 | PL00001bbbbbb |  |  |  |  |  |
| podmiot2 | PL00001cccccc |  |  |  |  |  |
| *...* | ... |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

\* Wypełnić, gdy odpowiednie minimum, zgodnie z regulacjami Rynku elektronicznego, nie jest spełnione.

Uwaga: Tabelę sporządza Podmiot prowadzący Rynek elektroniczny.

**Załącznik 7.6**

Kwotowanie SPW na Rynku elektronicznym określone w § 15 ust. 2 pkt 2 Regulaminu pełnienia funkcji Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych …*(data)*…

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **DSPW lub Kandydat** | **ISIN SPW** | **średni spread ważony czasem (pb)** | **średni wolumen ważony czasem(mln zł)** | **łączny czas kwotowania****(hh:mm:ss)** | **spread referencyjny (pb)** | **wolumen referencyjny(mln zł)** | **czas referencyjny****(hh:mm:ss)** |
| podmiot1 | PL00001aaaaaa |  |  |  |  |  |  |
| podmiot1 | PL00001bbbbbb |  |  |  |  |  |  |
| podmiot1 | PL00001cccccc |  |  |  |  |  |  |
| ... | ... |  |  |  |  |  |  |
| podmiot2 | PL00001aaaaaa |  |  |  |  |  |  |
| podmiot2 | PL00001bbbbbb |  |  |  |  |  |  |
| podmiot2 | PL00001cccccc |  |  |  |  |  |  |
| *...* | ... |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |

Uwaga: Tabelę sporządza Podmiot prowadzący Rynek elektroniczny.

**Załącznik 7.7**

Statystyka kwotowań SPW na Rynku elektronicznym …*(data)*…

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *-1-* | *-2-* | *-3-* | *-4-* | *-5-* | *-6-* | *-7-* | *-8-* | *-9-* | *-10-* | *-11-* | *-12-* | *-13-* | *-14-* | *-15-* | *-16-* | *-17-* | *-18-* | *-19-* | *-20-* | *-21-* | *-22-* |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

gdzie numery poszczególnych kolumn oznaczają:

1. data sesji (rrrr-mm-dd),
2. kod ISIN instrumentu,
3. czas, przez jaki określony był spread (gg:mm:ss),
4. średni spread pomiędzy najlepszym poziomem cenowym kupna i najlepszym poziomem cenowym sprzedaży ważony czasem trwania (pb),
5. czas kwotowania przynajmniej jednego poziomu kupna (gg:mm:ss),
6. średni kurs najlepszego poziomu cenowego kupna ważony czasem trwania (%),
7. rentowność kursu z kolumny nr 6 (%),
8. średni wolumen najlepszego poziomu cenowego kupna ważony czasem trwania (mln zł),
9. średnia ważona czasem trwania ze średniego kursu wszystkich poziomów cenowych kupna ważonych wolumenem (%),
10. rentowność kursu z kolumny nr 9 (%),
11. średnia ważona czasem trwania z sumy wolumenów wszystkich poziomów cenowych kupna (mln zł),
12. średnia ważona czasem trwania ze średniego kursu wszystkich poziomów cenowych kupna (%),
13. rentowność kursu z kolumny nr 12 (%),
14. czas kwotowania przynajmniej jednego poziomu sprzedaży (gg:mm:ss),
15. średni kurs najlepszego poziomu cenowego sprzedaży ważony czasem trwania (%),
16. rentowność kursu z kolumny nr 15 (%),
17. średni wolumen najlepszego poziomu cenowego sprzedaży ważony czasem trwania (mln zł),
18. średnia ważona czasem trwania ze średniego kursu wszystkich poziomów cenowych sprzedaży ważonych wolumenem (%),
19. rentowność kursu z kolumny nr 18 (%),
20. średnia ważona czasem trwania z sumy wolumenów wszystkich poziomów cenowych sprzedaży (mln zł),
21. średnia ważona czasem trwania ze średniego kursu wszystkich poziomów cenowych sprzedaży (%),
22. rentowność kursu z kolumny nr 21 (%).

Uwaga: Tabelę sporządza Podmiot prowadzący Rynek elektroniczny.

**Załącznik 8**

*(pieczęć firmowa podmiotu)*

### OŚWIADCZENIE

Stosownie do postanowień § 20 Regulaminu pełnienia funkcji Dealera Skarbowych Papierów Wartościowych wskazujemy poniższe rynki jako preferowane przez nas rynki elektronicznego obrotu SPW:

 1. …(*nazwa rynku oraz podmiotu prowadzącego rynek)*… (2 punkty)

 2. …(*nazwa rynku oraz podmiotu prowadzącego rynek)*… (1 punkt)

|  |
| --- |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |
| Podpis: |
| Imię i nazwisko: |
| Stanowisko: |
| Data: |

1. Wypełnia tylko podmiot zagraniczny. [↑](#footnote-ref-1)
2. Dotyczy podmiotów krajowych. Dane przekazywane są według stanu na koniec każdego kwartału i zawierają informacje o: gotówce w kasie, stanie środków na rachunku w NBP, lokatach międzybankowych, rachunkach nostro w bankach, kredytach zagrożonych klientów niefinansowych, kredytach zagrożonych sektora budżetowego, kredytach straconych klientów niefinansowych, kredytach straconych sektora budżetowego, kredytach klientów niefinansowych, kredytach sektora budżetowego, sumie aktywów netto, zobowiązaniach ogółem, zysku netto, funduszach własnych, łącznym współczynniku kapitałowym. [↑](#footnote-ref-2)