

REGULAMIN SYSTEMU RAPORTOWANIA EMIR W TMS BROKERS

Definicje

ESMA – European Security and Market Authority.

Czas Odcięcia – umowny czas zamknięcia rynków ustalony przez TMS Brokers, które zachowują ciągłość obrotu 24 godziny na dobę. Dla systemu transakcyjnego TMS Direct jest to godzina 21 GMT. Dla systemów TMS Pro, TMS Connect oraz GO4X jest to godzina 23:55.

Data Rozbieżności – dzień, w którym Klient skutecznie dostarczy do TMS Brokers informację w zakresie Rozbieżności na warunkach wskazanych w sekcji V. niniejszego Regulaminu.

EMIR (Rozporządzenie EMIR) – oznacza rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady numer 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji z dnia 4 lipca 2012 r.

Instrument Pochodny – oznacza instrument finansowy zdefiniowany w Artykule 2 (5) Rozporządzenia EMIR.

Klient – Kontrahent w rozumieniu EMIR, który zawarł Umowę lub Umowę Ramową z TMS Brokers i zawiera transakcje w oparciu o tę umowę.

Kluczowe Warunki – oznacza w odniesieniu do Transakcji jej nominał, walutę, instrument bazowy, stronę transakcji, datę rozliczenia, datę wykonania, datę wejścia w życie oraz wycenę.

LEI - Legal Entity Identifier, kod identyfikujący Kontrahenta składający się z 20 znaków alfanumerycznych.

Regulacje EMIR - oznacza Rozporządzenie EMIR wraz z wszelkimi towarzyszącymi mu przepisami wykonawczymi.

Regulamin – niniejszy Regulamin Systemu Raportowania EMIR w TMS Brokers.

Repozytorium Transakcji – oznacza autoryzowany przez ESMA podmiot, o którym mowa w Artykule 2 (2) Rozporządzenia EMIR.

Rozbieżność – oznacza jakąkolwiek rozbieżność pomiędzy Klientem a TMS Brokers w zakresie Kluczowych Warunków odnoszących się do Transakcji.

System Raportowania – organizowany przez TMS Brokers system przeznaczony do raportowania transakcji zawartych przez Klientów do Repozytorium Transakcji.

Systemy Transakcyjne – wszelkie oferowane przez TMS Brokers elektroniczne systemy służące do zawierania Transakcji.

TMS Brokers – Dom Maklerski TMS Brokers S.A.

Transakcja – to transakcja zawarta pomiędzy Klientem a TMS Brokers w Instrumencie Pochodnym.

Wniosek – wniosek o przystąpienie do Systemu Raportowania, którego wzór stanowi Załącznik numer 2 do niniejszego Regulaminu

I. Postanowienia ogólne

1. TMS Brokers w ramach oferowanego Systemu Raportowania raportuje w imieniu Klienta wyłącznie Transakcje realizowane przez Klienta w Systemach Transakcyjnych TMS Brokers na podstawie zawartych Umów lub Umów Ramowych.
2. Raportowanie Transakcji do Repozytorium Transakcji w imieniu Klienta nie stanowi outsourcingu w znaczeniu przepisów Ustawy o obrocie instrumentami finansowymi (art. 81a-g)).
3. Obowiązek raportowania ciąży na każdym podmiocie zawierającym Transakcje, a przystąpienie do Systemu Raportowania organizowanego przez TMS Brokers nie zwalnia Klienta z tego obowiązku. Klient powinien regularnie sprawdzać, czy obowiązek raportowania został spełniony i czy dane zawarte we wskazanym przez TMS Brokers Repozytorium Transakcji są poprawne.
4. Definicje wskazane z dużej litery nie wyjaśnione w sekcji Definicje niniejszego Regulaminu mają znaczenie takie samo jak wskazane w Umowie lub Umowie Ramowej.
5. Klient powinien być świadomy, że należy unikać podwójnego raportowania tych samych Transakcji do Repozytoriów Transakcji.

II. Przystąpienie do Systemu Raportowania

1. Przystąpienie do Systemu Raportowania wymaga:
 - a. wypełnienia wszystkich rubryk we wniosku o przystąpienie do Systemu Raportowania (zwanego Wnioskiem) oraz
 - b. podpisania przez Klienta Wniosku oraz
 - c. akceptacji zasad zawartych w niniejszym Regulaminie.
2. Brak wypełnienia przez Klienta danych wskazanych we Wniosku spowoduje odmowę przyjęcia Klienta do Systemu Raportowania.
3. O przyjęciu albo odrzuceniu Wniosku Klienta, Klient zostanie poinformowany przez TMS Brokers w terminie 3 dni od dnia skutecznego przekazania tego Wniosku.
4. Przystępując do Systemu Raportowania organizowanego przez TMS Brokers klient musi posiadać LEI albo pre-LEI. Wnioski Klientów nie zawierające LEI albo pre-LEI będą odrzucane.
5. TMS Brokers rozpoczyna raportowanie transakcji Klienta najpóźniej od pierwszego dnia roboczego następującego po dniu przyjęcia Klienta do Systemu Raportowania.
6. Niezależnie od informacji podanych przez Klienta w trakcie przystępowania do Systemu Raportowania zawartych we Wniosku, Klient zobowiązany jest do każdorazowej aktualizacji tych danych w razie ich zmiany. W szczególności dotyczy to statusu Klienta lub danych w przedmiocie celu zawierania transakcji.

7. TMS Brokers dokonuje raportowania w oparciu o zaktualizowane dane Klienta w ciągu 3 dni roboczych od dnia otrzymania aktualizacji od Klienta.

III. Zasady raportowania oraz zasady wyceny

1. TMS Brokers w zakresie doboru Repozytorium Transakcji podejmuje suwerenną decyzję.
2. Informacja w zakresie aktualnego Repozytorium Transakcji wykorzystywanego do raportowania transakcji będzie publikowana na stronach TMS Brokers. Informacja o zmianie w Repozytorium Transakcji zostanie przekazana Klientowi z wyprzedzeniem 14 dni kalendarzowych poprzez wywieszenie na stronie internetowej informacji o wyborze nowego Repozytorium Transakcji.
3. TMS Brokers dokonuje raportowania transakcji do Repozytorium Transakcji na podstawie aktualnie obowiązujących przepisów prawnych oraz ewentualnych wytycznych kompetentnych pomiotów (np. EMSA, KNF)
4. Transakcje będą raportowane każdego dnia roboczego za poprzedni dzień roboczy.
5. Wycena transakcji będzie realizowana raz dziennie.
6. Kontrakty na różnicę kursową będą wyceniane w relacji do ceny instrumentu bazowego. Informacja o instrumencie bazowym znajduje się w Specyfikacji Instrumentów Finansowych. Cena instrumentu bazowego może być skorygowana o stosowny markup bid/offer.
7. Ilekroć instrumentem bazowym będzie instrument z rynku zorganizowanego, do wyceny będzie wykorzystywana cena zamknięcia tego instrumentu na rynku zorganizowanym
8. Ilekroć instrumentem bazowym będzie instrument rynku OTC, do wyceny będzie brany kurs własny TMS Brokers pochodzący z Czasu Odcięcia.
9. Wycena przy użyciu modelu ma miejsce dla instrumentów pochodnych o charakterze warunkowym. Wycena odbywa się przy użyciu uznanych metod wyceny instrumentów o charakterze warunkowym. TMS Brokers informuje, że dla opcji OTC stosuje się model wyceny
10. Ilekroć wycena będzie denominowana w walucie obcej, przeliczenie na walutę bazową Rachunku Pieniężnego będzie następowało po kursie TMS Brokers z Czasu Odcięcia dostępnego w Systemie Transakcyjnym.
11. Na potrzeby raportowania Transakcji do Repozytorium Transakcji TMS Brokers uznaje, że wszystkie Transakcje zawierane przez Klienta są transakcjami spekulacyjnymi.
12. Wartość zabezpieczenia (depozyt) będzie pobierana zgodnie z zapisami Specyfikacji Instrumentów Finansowych lub zgodnie z wymogami danej izby clearingowej.
13. Jeśli Klient posiada więcej niż jedną pozycję otwartą, jego rachunek traktowany jest jako portfel zgodnie z Regulacjami EMIR, a wartość zabezpieczenia będzie wyliczana dla całego portfela.

IV. Mitygacja ryzyka

1. TMS Brokers w Systemach Transakcyjnych przekazuje Klientowi raporty o zawartych Transakcjach, ich Kluczowych Warunkach oraz wartości zabezpieczenia. Obowiązkiem Klienta

jest monitorowanie zawartych Transakcji i potwierdzanie Kluczowych Warunków zawartej Transakcji oraz wartości zabezpieczenia w ciągu kolejnego dnia roboczego następującego po dacie zawarcia Transakcji. Dla Transakcji zawartych po godzinie 16:00 polskiego czasu termin ten ulega wydłużeniu o kolejny dzień roboczy.

2. Brak zgłoszenia Rozbieżności w przedmiocie Kluczowych Warunków Transakcji lub wartości zabezpieczenia portfela w terminie, o którym mowa w ustępie 1 oznacza, że Klient bezwzględnie potwierdza Kluczowe Warunki Transakcji oraz wartość zabezpieczenia portfela.
3. Wszystkie potwierdzone przez Klienta Transakcje uznaje się za uzgodnione zgodnie z Regulacjami EMIR.
4. TMS Brokers raz na pół roku będzie przeprowadzał analizę możliwości kompresji portfela. Analiza możliwości kompresji będzie dokonywana o ile Klient będzie posiadał otwartych co najmniej 500 pozycji w TMS Brokers.
5. Kompresja portfela będzie polegała na połączeniu otwartych pozycji Klienta. W szczególności kompresja będzie polegała na zamknięciu wielu pozycji otwartych w Instrumencie Pochodnym opartym o ten sam instrument bazowy, a następnie otwarcie jednej Transakcji w nominale netto pozycji sprzed kompresji.
6. Proces kompresji nie jest procesem automatycznym. TMS Brokers każdorazowo przez próbą kompresji portfela będzie podejmował kontakt z Klientem. Zgoda Klienta warunkuje realizację operacji kompresji portfela.
7. W przypadku istotnej Rozbieżności co do Kluczowych Warunków Transakcji zawartych Transakcji, ich wyceny lub wartości zabezpieczenia, Klient powinien zgłosić swoje zastrzeżenia na adres dok@tms.pl w nieprzekraczalnym terminie, o którym mowa w ustępie 1.
8. Na potrzeby definicji Rozbieżności ustala się, że kwota Rozbieżności powinna przekraczać wartość 5000 EUR, aby mogła być rozpatrywana w trybie określonym w niniejszym Regulaminie
9. Rozbieżność powinna zawierać w szczególności:
 - a. Datę, w jakiej została zidentyfikowana przez Klienta
 - b. Wskazanie Transakcji oraz Kluczowych Warunków tej Transakcji lub wartości zabezpieczenia portfela, w odniesieniu do których Klient zidentyfikował Rozbieżność;
 - c. Oszacowanie przez klienta Wartości Kluczowego Warunku Transakcji lub wartości zabezpieczenia portfela, jaka jego zdaniem powinna znaleźć się w raportach dostarczanych przez TMS Brokers w Systemach Transakcyjnych.
10. W informacji o Rozbieżnościach Klient powinien wyraźnie wskazać, że dotyczą one Transakcji w ramach Systemu Raportowania.
11. Informacje o Rozbieżnościach niespełniające warunków zapisanych w niniejszym Regulaminie będzie identyfikowana i rozpatrywana jako skarga zgodnie z zapisami regulaminu właściwego dla danej usługi.
12. TMS Brokers zobowiązuje się do weryfikacji zastrzeżeń Klienta, o których mowa w ustępie 8 w terminie 5 dni roboczych od Daty Rozbieżności
13. W razie nierozwiązania Rozbieżności w terminie, o którym mowa w powyżej zarówno Klient jak i TMS Brokers zobowiązują się do poinformowania swoich Zarządów o przedmiocie

Rozbieżności oraz o tym, że Rozbieżności nie udało się rozwiązać. Zarządy starają się działając w dobrej wierze rozwiązać Rozbieżność w ciągu kolejnych 10 dni roboczych.

14. Jeśli Rozbieżność nadal nie zostanie rozwiązana do tego czasu, TMS Brokers zamknie Transakcję Klienta, do której odnosi się Rozbieżność. Klient na powyższe wyraża zgodę.

V. Opłaty

1. Opłaty z tytułu raportowania w imieniu Klienta Transakcji do Repozytorium Transakcji zawarte zostały w załączniku numer 1 do niniejszego Regulaminu.
2. TMS Brokers ma prawo do dokonania zmian wysokości opłat za pisemnym powiadomieniem w terminie 14 dni. Powiadomienie następuje poprzez wywieszenie informacji o nowej wysokości opłat na stronie internetowej TMS Brokers (www.tms.pl)
3. Opłaty będą potrącone z Rachunku Pieniężnego Klienta w kolejnym dniu następującym po dniu zawarcia Transakcji. Przystępując do Systemu Raportowania Klient wyraża zgodę na powyższe.
4. Klient wyraża dla TMS Brokers zgodę na pobieranie z Rachunków Pieniężnych Klienta prowadzonych przez TMS Brokers opłat z tytułu realizacji obowiązku raportowania Transakcji do Repozytorium Transakcji.
5. TMS Brokers będzie mógł pobierać środki z dowolnego Rachunku Pieniężnego wedle własnego uznania, przy czym w pierwszej kolejności będzie pobierał środki z Rachunku Pieniężnego, powiązanego z rachunkiem lub rejestrem, którego raportowanie dotyczy, a jeśli na tym Rachunku Pieniężnym nie będzie środków pieniężnych – wtedy także z innych Rachunków Pieniężnych Klienta.
6. TMS Brokers może odmówić wykonania obowiązku raportowego, jeśli Klient nie posiada żadnych środków na Rachunkach Pieniężnych.
7. Z tytułu pobranych opłat na koniec każdego miesiąca kalendarzowego, TMS Brokers wystawi Klientowi fakturę. TMS Brokers nie wystawi faktury, jeśli z tytułu raportowania nie pobierze w danym miesiącu żadnych opłat z Rachunków Pieniężnych Klienta.

VI. Postanowienia końcowe

1. Klient ma prawo do odstąpienia od Systemu Raportowania w każdym czasie za 7 dniowym okresem wypowiedzenia liczonym od daty otrzymania przez TMS Brokers oświadczenia woli o odstąpieniu od Systemu Raportowania. Oświadczenie woli musi mieć formę pisemną.
2. TMS Brokers nie ponosi odpowiedzialności za niezrealizowanie lub błędne realizowanie obowiązków raportowych jakie ciążyą na Kliencie. Klient oświadcza, że nie będzie z tego tytułu podnosił żadnych roszczeń względem TMS Brokers.
3. Klient przez cały okres raportowania przez TMS Brokers będzie utrzymywał ważny numer LEI, a w szczególności odprowadzał opłaty za jego odnawianie.
4. TMS Brokers rezerwuje sobie prawo do zmiany niniejszego Regulaminu w każdym momencie bez wcześniejszego zawiadomienia Klienta. Prawo to wygasa 12 lutego 2014 roku. W razie

kolizji z innymi przepisami zawartymi w niniejszym Regulaminie, termin opisany w punkcie 4 sekcji VI. będzie miał charakter rozstrzygający.

5. Po okresie, o którym mowa powyżej TMS Brokers rezerwuje sobie prawo do zmiany niniejszego Regulaminu w każdym czasie. Zmiany wchodzi w życie w ciągu 14 dni od dnia ogłoszenia o zmianach w Regulaminie.
6. Zmiana Regulaminu odbywa się poprzez wywieszenie nowej wersji Regulaminu na stronie internetowej TMS Brokers (www.tms.pl).

Załącznik 1 do Systemu raportowania EMIR w TMS Brokers

OPŁATY ZA KORZYSTANIE Z SYSTEMU RAPORTOWANIA TMS BROKERS

Przedmiot opłaty	Wysokość opłaty
Przystąpienie do Systemu Raportowania	0,00 PLN
Zgłoszenie transakcji do Repozytorium Transakcji	0,00 PLN
Opłata za utrzymanie informacji o kontrakcie	0,00 PLN

Powyższe ceny są cenami netto

WNIOSEK O PRZYSTĄPIENIE DO SYSTEMU RAPORTOWANIA EMIR W TMS BROKERS

Nazwa Kontrahenta						
Numer KRS/REGON						
Numer LEI						
Status Kontrahenta lub całej grupy:	Finansowy	<input type="checkbox"/>	Niefinansowy "-"	<input type="checkbox"/>	Niefinansowy "+"	<input type="checkbox"/>

1. Kontrahent niniejszym oświadcza, że chce przystąpić do Sytemu Raportowania organizowanego przez TMS Brokers na zasadach zapisanych w Regulaminie Systemu Raportowania EMIR w TMS Brokers (dalej Regulamin).
2. Kontrahent oświadcza, że zapoznał się i akceptuje treść warunków Regulaminu.
3. Kontrahent oświadcza, że dane zawarte we wniosku są prawdziwe.
4. Kontrahent oświadcza, że jest świadomy, że w razie jakiegokolwiek zmiany danych zobowiązany jest niezwłocznie je zaktualizować.

Data złożenia oświadczenia:

Podpis

Imię i nazwisko

Stanowisko

Podpis

Imię i nazwisko

Stanowisko

Data przyjęcia oświadczenia (wypełnia TMS Brokers):

INFORMACJA O STATUSACH KONTRAHENTÓW

1. Kontrahent finansowy oznacza przedsiębiorstwa inwestycyjne, którym udzielono zezwolenia zgodnie z dyrektywą 2004/39/WE, instytucje kredytowe, którym udzielono zezwolenia zgodnie z dyrektywą 2006/48/WE, zakłady ubezpieczeń, którym udzielono zezwolenia zgodnie z dyrektywą 73/239/EWG, zakłady ubezpieczeń, którym udzielono zezwolenia zgodnie z dyrektywą 2002/83/WE, zakłady reasekuracji, którym udzielono zezwolenia zgodnie z dyrektywą 2005/68/WE, UCITS i odpowiednio, ich spółek zarządzających, którym udzielono zezwolenia zgodnie z dyrektywą 2009/65/WE, instytucje pracowniczych programów emerytalnych w rozumieniu art. 6 lit. a) dyrektywy 2003/41/WE oraz alternatywne fundusze inwestycyjne zarządzane przez zarządców alternatywnych funduszy inwestycyjnych, którym udzielono zezwolenia lub które zarejestrowano zgodnie z dyrektywą 2011/61/UE;

2. Kontrahentem niefinansowym “+” jest Kontrahent w rozumieniu regulacji EMIR, którego otwarte pozycje przekroczą wartość:

(a) 1 miliard EUR wartości nominalnej brutto dla derywatów kredytowych OTC;

(b) 1 miliard EUR wartości nominalnej brutto dla derywatów kapitałowych OTC;

(c) 3 miliardy EUR wartości nominalnej brutto dla derywatów opartych o stopę procentową OTC;

(d) 3 miliardy EUR wartości nominalnej brutto dla derywatów opartych o waluty;

(e) 3 miliardy EUR wartości nominalnej brutto dla derywatów towarowych I innych pochodnych niewymienionych w punktach (a) – (d)

3. Kontrahentem niefinansowym “-” jest każdy inny Kontrahent w rozumieniu regulacji EMIR