

Wytyczne w zakresie obowiązków sprawozdawczych podmiotu prowadzącego system rozrachunku w zakresie działalności rozliczeniowej

Wytyczne są materiałem pomocniczym w procesie pozyskiwania przez Prezesa NBP informacji niezbędnych do analizy oraz oceny zgodności funkcjonowania systemu rozrachunku w zakresie działalności rozliczeniowej (dalej „system rozliczeń”) z wymogami ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi (dalej „ustawa o obrocie instrumentami finansowymi”).

Zgodnie z art. 68f ust. 1-3 i art. 68g ustawy o obrocie instrumentami finansowymi oraz rozporządzeniem Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 8 maja 2017 r. w sprawie danych i informacji przekazywanych przez podmioty prowadzące depozyt papierów wartościowych, system rejestracji instrumentów finansowych niebędących papierami wartościowymi oraz system rozrachunku podmiot prowadzący system rozliczeń jest zobowiązany do przekazywania Prezesowi NBP danych i informacji na potrzeby realizacji obowiązku wynikającego ze sprawowania przez Prezesa NBP nadzoru systemowego zgodnie z „Polityką sprawowania przez Narodowy Bank Polski nadzoru systemowego w zakresie systemu płatniczego”¹. O ile nie określono inaczej, pojęcia stosowane i zdefiniowane w ustawie o obrocie instrumentami finansowymi oraz ustawie z dnia 24 sierpnia 2001 r. o ostateczności rozrachunku w systemach płatności i systemach rozrachunku papierów wartościowych oraz zasadach nadzoru nad tymi systemami mają takie samo znaczenie w niniejszych Wytycznych.

Wytyczne zostały przygotowane w celu uproszczenia i ujednolicenia sposobu przekazywania wymaganych informacji; składają się z następujących części:

1. Tryb przekazywania informacji;
2. Procedura przekazywania danych;
3. Procedura powiadamiania o incydencie;
4. Procedura powiadamiania o zmianie na liście uczestników;
5. Procedura powiadamiania o gwarantowanej przepustowości;
6. Procedura powiadamiania o wynikach testów warunków skrajnych.

¹ <https://nbp.pl/wp-content/uploads/2022/07/polityka.pdf>

1. Tryb przekazywania informacji

Informacje należy przysyłać na adres poczty elektronicznej raporty.oversight@nbp.pl w następującym trybie:

1. kwartalnie, w terminie do ostatniego dnia miesiąca następującego po miesiącu kończącym dany kwartał, zgodnie z **Załącznikiem nr 1 – Statystyka**,
2. incydentalnie:
 - informacje o zaistniałym incydencie zgodnie z **Załącznikiem nr 2 – Incydent**, w terminach określonych w części pt. „Procedura powiadamiania o incydencie”,
 - po każdej zmianie listy uczestników systemu rozliczeń informacje zgodnie z **Załącznikiem nr 3 – Uczestnicy**,
 - po każdej zmianie w gwarantowanej przepustowości informacje zgodnie z **Załącznikiem nr 4 – Przepustowość**.

2. Procedura przekazywania danych

Podmiot prowadzący system rozliczeń przekazuje Prezesowi NBP dane dotyczące bieżącego funkcjonowania prowadzonego systemu rozliczeń zgodnie z **Załącznikiem nr 1 – Statystyka**.

Poszczególne pola kolejnych formularzy należy wypełnić odpowiednio:

Formularz nr 1 – Dane identyfikujące sprawozdanie

Nazwa systemu – należy podać pełną nazwę prowadzonego przez podmiot systemu rozliczeń.

Rok – należy podać rok, którego dotyczy bieżąca sprawozdawczość w formacie RRRR.

Kwartał – należy podać kwartał, którego dotyczy bieżąca sprawozdawczość w formacie I kw., II kw., III kw. lub IV kw. dla odpowiednich kwartałów.

Formularz nr 2 – Liczba i wartość rozliczonych transakcji

Nazwa miesiąca – należy podać pełną nazwę kalendarzową miesiąca.

Liczba rozliczonych transakcji – należy podać dokładną liczbę rozliczonych transakcji w systemie rozliczeń w danym typie instrumentów finansowych w podziale na rynek zorganizowany i rynek OTC. Kategorie zbiorcze liczby rozliczonych transakcji na

instrumentach finansowych powinny być sumą liczby poszczególnych rozliczonych transakcji na instrumentach wchodzących w ich skład.

Wartość rozliczonych transakcji – należy podać wartość rozliczonych transakcji w systemie rozliczeń w danym typie instrumentów finansowych w podziale na rynek zorganizowany i rynek OTC, w zaokrągleniu do tysiąca PLN. Kategorie zbiorcze wartości rozliczonych transakcji na instrumentach finansowych powinny być sumą wartości poszczególnych rozliczonych transakcji na instrumentach wchodzących w ich skład. Wartość rozliczonych transakcji określa się przed zastosowaniem nowacji rozliczeniowej. Wartości wyrażone w walutach obcych należy przeliczyć na PLN według średniego kursu NBP z ostatniego dnia miesiąca w danym kwartale sprawozdawczym.

Formularz nr 3 – Liczba dni operacyjnych oraz dostępność operacyjna systemu

Nazwa miesiąca – należy podać pełną nazwę kalendarzową miesiąca.

Liczba dni operacyjnych – należy podać liczbę dni kalendarzowych, w których realizowano zlecenia rozrachunku w podziale na rynek zorganizowany i rynek OTC.

Dostępność operacyjna systemu – to procentowy wskaźnik wydajności systemu rozliczeniowego prezentujący informację o dostępności systemu dla uczestników (tj. w czasie kiedy przyjmowane są zlecenia rozrachunku, zapytania oraz realizowane są operacje rozrachunku). Wskaźnik nie obejmuje czasu planowanej niedostępności systemu (wynikającej np. z konserwacji systemu), kiedy w jego trakcie przyjmowane są zlecenia rozrachunku i zapytania, ale operacje rozrachunku nie są realizowane. W sytuacji, gdy godziny przyjmowania zleceń rozrachunku i ich przeprowadzenie są różne należy przyjąć najszerszy zakres operacyjny stosowany przez dany system rozliczeń.

Przykład 1.

Jeżeli zgodnie z zasadami funkcjonowania systemu rozliczeń przewiduje się jego dostępność dla uczestników w godzinach od 8 do 17 to czas dostępności operacyjnej w danym dniu operacyjnym wynosi 9 godzin. W miesiącu, w którym występuje 20 dni operacyjnych, teoretyczny łączny czas dostępu do takiego systemu rozliczeń wynosi 180 godzin (tj. iloczyn 20 dni operacyjnych i 9 godzin dostępności), przy założeniu braku zakłóceń w prawidłowym funkcjonowaniu systemu. W takim przypadku wskaźnik dostępności operacyjnej systemu rozliczeń wynosi 100%.

Przykład 2.

Jeżeli w systemie, o którym mowa w *Przykładzie 1.*, wystąpią incydenty, które w konsekwencji spowodują niedostępność systemu dla uczestników o łącznym czasie

wynoszącym 4 godziny, wtedy wskaźnik dostępności operacyjnej systemu rozliczeń oblicza się zgodnie z formułą:

$$\text{Dostępność operacyjna systemu} = \left(1 - \frac{\text{łączny czas niedostępności systemu wynikającej z zaistniałych incydentów w danym miesiącu}}{\text{teoretyczny łączny czas dostępności operacyjnej miesiącu}} \right) * 100\%$$

Zgodnie z powyższą formułą, dostępność operacyjna dla systemu opisanego w przykładzie wynosi 97,78%.

Formularz nr 4 - Wartości obrotu generowane przez poszczególnych uczestników

Nazwa miesiąca – należy podać pełną nazwę kalendarzową miesiąca.

Nazwa uczestnika – należy podać pełną nazwę uczestnika.

Kod uczestnika – należy podać unikalny kod uczestnika systemu rozliczeń.

Wartość generowanego obrotu w miesiącu – należy podać łączną wartość transakcji dokonanych przez danego uczestnika systemu w danym miesiącu, w zaokrągleniu do tysiąca PLN. Wartość transakcji określa się przed zastosowaniem nowacji rozliczeniowej. Wartości wyrażone w walutach obcych należy przeliczyć na PLN według średniego kursu NBP z ostatniego dnia miesiąca w danym kwartale sprawozdawczym.

Formularz nr 5 - Uczestnicy generujący najwyższą skumulowaną wartość rozliczonych transakcji

Nazwa miesiąca – należy podać pełną nazwę kalendarzową miesiąca.

Nazwa uczestnika – należy podać pełną nazwę uczestnika.

Kod uczestnika – należy podać unikalny kod uczestnika systemu rozliczeń.

Wartość skumulowanego obrotu w miesiącu – należy podać wartość transakcji dokonanych przez uczestnika systemu generującego ich najwyższą skumulowaną wartość w danym typie instrumentów finansowych w podziale na rynek zorganizowany i rynek OTC od dnia 1 stycznia roku sprawozdawczego do ostatniego dnia bieżącego okresu sprawozdawczego, w zaokrągleniu do tysiąca PLN. Kategorie zbiorcze wartości rozliczonych transakcji na instrumentach finansowych powinny być sumą wartości poszczególnych rozliczonych transakcji na instrumentach wchodzących w ich skład. Wartość transakcji określa się przed zastosowaniem nowacji rozliczeniowej. Wartości wyrażone w walutach obcych należy przeliczyć na PLN według średniego kursu NBP z ostatniego dnia poszczególnych miesięcy w danym kwartale sprawozdawczym.

Formularz nr 6 - Maksymalna przepustowość systemu

Nazwa miesiąca – należy podać pełną nazwę kalendarzową miesiąca.

Liczba transakcji zrealizowanych w systemie w jednym dniu – należy podać wartość określającą maksymalną liczbę transakcji zrealizowanych w systemie rozliczeń, która została odnotowana w jednym dniu operacyjnym w danym miesiącu kwartału sprawozdawczego w podziale na rynek zorganizowany oraz rynek OTC i z uwzględnieniem daty jej wystąpienia.

Liczba transakcji zrealizowanych w systemie w ciągu godziny – należy podać wartość określającą maksymalną liczbę transakcji zrealizowanych w systemie rozliczeń, która została odnotowana w ciągu jednej godziny w danym miesiącu kwartału sprawozdawczego w podziale na rynek zorganizowany oraz rynek OTC i z uwzględnieniem daty jej wystąpienia.

Formularz nr 7 - Wielkości wykorzystanych środków z systemu gwarantowania rozliczeń

Nazwa miesiąca – należy podać pełną nazwę kalendarzową miesiąca.

Wartość całkowita wykorzystanych przez CCP² środków z systemu gwarantowania rozliczeń – należy podać dokładną całkowitą wartość środków wykorzystanych z systemu gwarantowania rozliczeń i rozrachunku będącą sumą wykorzystanych wstępnych depozytów zabezpieczających, wpłat do funduszu na wypadek niewykonania zobowiązania, własnych zasobów celowych oraz pozostałych kapitałów własnych podmiotu prowadzącego system rozliczeń.

Wykorzystane przez CCP środki z wstępnych depozytów zabezpieczających – należy podać dokładną wartość wykorzystanych środków ustalanych i pobieranych przez podmiot prowadzący system rozliczeń w celu ograniczenia ekspozycji kredytowych wobec swoich uczestników, w ramach systemu gwarantowania rozliczeń i rozrachunku³.

Wykorzystane przez CCP środki z własnych zasobów celowych – należy podać dokładną wartość wykorzystanych środków z własnych zasobów celowych, pozwalających podmiotowi prowadzącemu system rozliczeń na pokrycie ryzyka kredytowego, ryzyka

² Czyli podmiotu będącego CCP w rozumieniu Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 (dalej „rozporządzenie EMIR”).

³ Wstępne depozyty zabezpieczające – w rozumieniu art. 1 pkt 5) rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) nr 153/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniającego rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących wymogów obowiązujących kontrahentów centralnych.

kontrahenta i ryzyka rynkowego, wynikającego z tytułu niewykonania zobowiązania uczestnika.

Wykorzystane przez CCP środki z pozostałych kapitałów własnych podmiotu prowadzącego system – należy podać dokładną wartość wykorzystanych środków z pozostałych kapitałów własnych, pozwalających podmiotowi prowadzącemu system rozliczeń na pokrycie ryzyka kredytowego, ryzyka kontrahenta i ryzyka rynkowego, wynikającego z tytułu niewykonania zobowiązania uczestnika.

Wykorzystane przez CCP środki z pozostałych środków systemu gwarantowania rozliczeń – należy podać dokładną wartość wykorzystanych środków innych niż wstępne depozyty zabezpieczające, wpłaty do funduszu na wypadek niewykonania zobowiązania, własne zasoby celowe i pozostałe kapitały własne podmiotu prowadzącego system rozliczeń (np. wpłaty dodatkowe wniesione do funduszu na wypadek niewykonania zobowiązania).

Wartość całkowita wykorzystanych przez podmiot niebędący CCP⁴ środków z systemu gwarantowania rozliczeń – należy podać dokładną całkowitą wartość środków wykorzystanych z systemu gwarantowania rozliczeń i rozrachunku będącą sumą wykorzystanych wstępnych depozytów zabezpieczających, wpłat do funduszu na wypadek niewykonania zobowiązania, własnych zasobów celowych oraz pozostałych kapitałów własnych podmiotu prowadzącego system rozliczeń.

Formularz nr 8 - Ekspozycje kredytowe uczestników względem podmiotu prowadzącego system

Nazwa uczestnika – należy podać pełną nazwę uczestnika.

Kod uczestnika – należy podać unikalny kod uczestnika systemu rozliczeń.

Całkowita ekspozycja kredytowa wobec podmiotu będącego CCP – należy podać całkowitą wartość ekspozycji kredytowych wobec podmiotu będącego CCP będącą sumą wstępnych depozytów zabezpieczających, wpłat do funduszy na wypadek niewykonania zobowiązania, wykorzystanych linii kredytowych oraz pozostałych ekspozycji kredytowych, w zaokrągleniu do tysiąca PLN według stanu na koniec okresu sprawozdawczego.

Ekspozycja kredytowa wobec CCP z środków z wstępnych depozytów zabezpieczających – należy podać wartość ustalonych i pobranych przez podmiot prowadzący system

⁴ Czyli podmiotu niebędącego CCP w rozumieniu rozporządzenia EMIR.

rozliczeń w celu ograniczenia ekspozycji kredytowych wobec swoich uczestników, w zaokrągleniu do tysiąca PLN.

Ekspozycja kredytowa wobec CCP z wpłaty do funduszy na wypadek niewykonania zobowiązania – należy podać wartość środków zabezpieczających prawidłowe wykonywanie zobowiązań wynikających z zawieranych transakcji, w zaokrągleniu do tysiąca PLN. Fundusz na wypadek niewykonania zobowiązania zapewnia rozliczanie transakcji w zakresie określonym w regulaminie funduszu, w ramach systemu gwarantowania rozliczeń i rozrachunku.

Ekspozycja kredytowa wobec CCP z wykorzystanych linii kredytowych – należy podać wartość aktualnie wykorzystywanych przez uczestników systemu (na podstawie odpowiednich umów) środków finansowych pochodzących z linii kredytowych zapewnianych podmiotowi prowadzącemu system rozliczeń, w zaokrągleniu do tysiąca PLN.

Pozostałe ekspozycje kredytowe wobec CCP – należy podać wartość ekspozycji kredytowych uczestników systemu z wyłączeniem wstępnych depozytów zabezpieczających, wpłat do funduszy na wypadek niewykonania zobowiązania i wykorzystanych linii kredytowych, w zaokrągleniu do tysiąca PLN.

Całkowita ekspozycja kredytowa wobec podmiotu niebędącego CCP – należy podać całkowitą wartość ekspozycji kredytowych wobec podmiotu niebędącego CCP będącą sumą wstępnych depozytów zabezpieczających, wpłat do funduszy na wypadek niewykonania zobowiązania, wykorzystanych linii kredytowych oraz pozostałych ekspozycji kredytowych, w zaokrągleniu do tysiąca PLN.

Formularz nr 9 - Linie kredytowe podmiotu prowadzącego system

Podmiot udzielający linii kredytowej – należy podać pełną nazwę podmiotu udzielającego linii kredytowej.

Wartość linii kredytowej – należy podać dokładną wartość limitów linii kredytowych przyznanych podmiotowi prowadzącemu system rozliczeń według stanu na koniec kwartału u sprawozdawczego.

Waluta linii kredytowej – należy podać kod waluty (trzyliterowy kod SWIFT), w jakiej podmiot prowadzący system rozliczeń ma przyznaną linię kredytową.

3. Procedura powiadamiania o incydencie

Incident w systemie rozliczeń - oznacza każde niespodziewane zdarzenie (zewnętrzne lub wewnętrzne, które może być zarówno umyślne, jak i przypadkowe), zaistniałe w związku z prowadzeniem systemu rozliczeń, mające lub mogące mieć negatywny wpływ na sprawne lub bezpieczne funkcjonowanie tego systemu. Zdarzeniem takim mogą być również awarie lub problemy u podmiotów trzecich (np. dostawców usług), o ile mają one lub mogą mieć negatywny wpływ na poprawne funkcjonowanie systemu rozliczeń.

Podmiot prowadzący system rozliczeń przekazuje Prezesowi NBP informacje o incydencie, zgodnie z **Załącznikiem nr 2 - Incident**, który składa się z następujących formularzy:

- Formularz nr 1 – *Wstępny raport nt. incydentu*,
- Formularz nr 2 – *Pośredni raport nt. incydentu*,
- Formularz nr 3 – *Końcowy raport nt. incydentu*.

Podmiot prowadzący system rozliczeń przekazuje informacje o incydencie w następującym trybie:

- Niezwłocznie, tj. do 2 godzin od wykrycia incydentu należy podać wstępne informacje zgodnie z Formularzem nr 1 - *Wstępny raport nt. incydentu*, który stanowi pierwsze powiadomienie o zaistniałym incydencie. Powinien zawierać informacje dostępne dla operatora systemu w chwili składania raportu.
- Nie później niż do 2 dni od wykrycia incydentu należy podać uszczegółowiony opis incydentu, zgodnie z Formularzem nr 2-*Pośredni raport nt. incydentu*, który stanowi uszczegółowienie poprzedniego (tj. wstępnego lub pośredniego) raportu nt. tego samego incydentu. Raport ten może zawierać dane szacunkowe. Dopuszczalne jest również przekazanie informacji o niedostępności niektórych danych w danym momencie. Wówczas aktualizacja przekazanych informacji powinna nastąpić w następnym raporcie. Raport pośredni należy systematycznie aktualizować po uzyskaniu dodatkowych, istotnych informacji.
- W ciągu 3 miesięcy od wykrycia incydentu należy przedstawić kompletną informację o incydencie, zgodnie z Formularzem nr 3 - *Końcowy raport nt. incydentu*, który stanowi podsumowujący raport, jaki podmiot prowadzący depozyt lub system rejestracji powinien przesłać odnośnie zaistniałego incydentu. Powinien zawierać szczegółowe informacje nt. przyczyn i skutków danego incydentu, a także informacje o działaniach zaradczych podjętych lub planowanych, by podobna sytuacja nie powtórzyła się w przyszłości. Może być aktualizowany i przekazywany wielokrotnie w

zależności od uzyskania przez podmiot prowadzący system rozliczeń istotnych informacji w procesie wyjaśniania incydentu lub wdrażania rozwiązań zapobiegających wystąpieniu podobnego zdarzenia w przyszłości.

Raport nt. incydentu należy sporządzić oddzielnie dla każdego incydentu.

Datę lub godzinę należy każdorazowo podawać w formacie RRRR-MM-DD gg:mm.

Wszystkie pola w formularzach są obowiązkowe, chyba że wyraźnie zaznaczono inaczej.

Poszczególne pola kolejnych formularzy Raportu nt. incydentu oznaczają odpowiednio:

Formularz nr 1 – Wstępny raport nt. incydentu

A1 – INFORMACJE OGÓLNE

Nazwa systemu rozliczeń – należy podać pełną nazwę prowadzonego przez podmiot systemu rozliczeń **wraz z określeniem rynku**, którego incydent dotyczy.

Nazwa podmiotu prowadzącego system rozliczeń – należy podać pełną nazwę podmiotu prowadzącego system rozliczeń.

Status incydentu – należy zaznaczyć właściwe pole wyboru dotyczące etapu podjętych działań.

Data i godzina przywrócenia poprawnego działania systemu rozliczeń – należy zaznaczyć właściwe pole wyboru oraz wskazać rok, miesiąc, dzień, godzinę i minutę momentu przywrócenia poprawnego działania systemu rozliczeń.

Czy uruchomiono plan ciągłości działania? – należy zaznaczyć właściwe pole wyboru.

A2 – PRZEBIEG I SKUTKI

Czas wykrycia incydentu – należy podać rok, miesiąc, dzień, godzinę i minutę wykrycia incydentu.

Początek incydentu – należy podać rok, miesiąc, dzień, godzinę i minutę, kiedy incydent się zaczął.

Koniec incydentu – należy podać rok, miesiąc, dzień, godzinę i minutę zakończenia incydentu.

Czas trwania incydentu – pole wypełnia się automatycznie po uzupełnieniu początku i końca incydentu.

Czas trwania niedostępności systemu – należy podać czas, w godzinach i minutach, w którym system pozostawał niedostępny.

Skutki incydentu – należy zaznaczyć właściwe pole wyboru dotyczące skutków. W przypadku zaznaczenia pola „Inne” należy skutki opisać w polu „Opis przebiegu i skutków incydentu”.

Opis przebiegu i skutków incydentu – należy szczegółowo opisać zdarzenie (bez względu na to co zaznaczono w polu wyboru), w szczególności podać informacje nt.:

- sposobu wykrycia incydentu,
- obszaru dotkniętego incydem z uwzględnieniem pozatransakcyjnych obszarów funkcjonowania systemu,
- wpływu incydentu na funkcjonalność operacyjną,
- jaki jest konkretny problem,
- jak ewoluował incydent,
- jakie były konsekwencje, w szczególności dla uczestników.

Formularz nr 2 – Pośredni raport nt. incydentu

A1 – INFORMACJE OGÓLNE

Należy wypełnić analogicznie jak *Wstępny raport nt. incydentu*, uzupełniając ewentualnie pole opisane poniżej:

Opis czynności w ramach uruchomionego planu ciągłości działania – w przypadku zaznaczenia pola wyboru „TAK” przy planie ciągłości działania, należy określić podjęte czynności w ramach uruchomionego planu.

A2 – PRZEBIEG I SKUTKI

Należy wypełnić analogicznie jak *Wstępny raport nt. incydentu*.

B1 – DANE SZCZEGÓŁOWE

Opóźnienie w rozliczeniu transakcji — należy podać w godzinach i minutach.

Liczba i wartość transakcji przetworzonych w dniu wystąpienia incydentu - należy podać całkowitą liczbę i wartość wszystkich zleceń zrealizowanych (niezależnie od tego czy zostały zrealizowane z opóźnieniem) i niezrealizowanych w dniu wystąpienia incydentu. Jeżeli incydent wykracza poza jedną dobę należy podać łączną liczbę i wartość transakcji przetworzonych we wszystkich dniach dotkniętych incydem. W przypadku wartości należy podać wartość rynkową transakcji bez stosowania zaokrągleń.

Liczba i wartość transakcji zainicjowanych w trakcie trwania incydentu – należy podać całkowitą liczbę i wartość wszystkich zleceń zainicjowanych w trakcie trwania incydentu, niezależnie od tego czy zostały rozliczone poprawnie czy też nie. W przypadku całkowitej niedostępności systemu należy oszacować, na podstawie przeszłych danych, liczbę i wartość zleceń jaka zostałaby zainicjowana. W przypadku wartości należy podać wartość rynkową transakcji bez stosowania zaokrągleń.

Liczba i wartość transakcji niezrealizowanych z powodu incydentu – należy podać całkowitą liczbę i wartość wszystkich zleceń, które nie zostały rozliczone. W przypadku wartości należy podać wartość rynkową transakcji bez stosowania zaokrągleń.

Liczba wszystkich uczestników systemu w dniu wystąpienia incydentu – należy podać liczbę podmiotów, będących uczestnikami danego systemu rozliczeń w dniu wystąpienia incydentu. Liczba ta powinna być zgodna z ostatnią przekazaną Listą uczestników (**Załącznikiem nr 3 - Uczestnicy**).

Liczba uczestników systemu dotkniętych incydem – należy podać realną liczbę uczestników, na których miał wpływ zaistniały incydent (tj. niezależnie od tego ile kanałów lub instancji u danego uczestnika zostało dotkniętych incydem, uległo awarii, było niedostępnych itp.).

Nazwa uczestnika systemu dotkniętego incydem – należy zaznaczyć właściwe pole wyboru.

B2 – PRZYCZYNY

Przyczyny incydentu – należy zaznaczyć właściwe pole wyboru. Przez cyberatak należy rozumieć jakiegokolwiek naruszenie bezpieczeństwa cybernetycznego systemu. W przypadku zaznaczenia pola „Inne” należy przyczyny opisać w polu „Opis przyczyn incydentu”.

Opis przyczyn incydentu – należy szczegółowo opisać przyczynę zaistniałego zdarzenia (bez względu na to co zaznaczono w polu wyboru), w tym podać następujące informacje o tym:

- Co spowodowało konkretny problem?
- Jak do tego doszło?
- Czy to zdarzenie było związane z poprzednim incydem?

B3 – DZIAŁANIA

Bieżące działania podjęte w celu usunięcia skutków incydentu – należy opisać jakie konkretnie działania zostały podjęte w celu usunięcia zaistniałego zdarzenia.

Formularz nr 3 – Końcowy raport nt. incydentu

A1 – INFORMACJE OGÓLNE

Należy wypełnić analogicznie jak *Pośredni raport nt. incydentu*.

A2 – PRZEBIEG I SKUTKI

Należy wypełnić analogicznie jak *Pośredni raport nt. incydentu*.

B1 – DANE SZCZEGÓŁOWE

Należy wypełnić analogicznie jak *Pośredni raport nt. incydentu*.

B2 – PRZYCZYNY

Należy wypełnić analogicznie jak *Pośredni raport nt. incydentu*.

B3 – DZIAŁANIA

Bieżące działania podjęte w celu usunięcia skutków incydentu - należy wypełnić analogicznie jak *Pośredni raport nt. incydentu*.

Planowane działania w celu zabezpieczenia się przed wystąpieniem podobnych przypadków w przyszłości – należy opisać jakie dodatkowe działania zostały lub zostaną podjęte przez podmiot prowadzący system rozliczeń w celu zabezpieczenia się przed wystąpieniem podobnych przypadków w przyszłości.

Planowany termin wdrożenia – należy podać przewidywany termin wdrożenia działań podjętych w celu zabezpieczenia się przed wystąpieniem podobnych przypadków w przyszłości (należy podać: rok, miesiąc, dzień).

4. Procedura powiadamiania o zmianie na liście uczestników

Podmiot prowadzący system rozliczeń przekazuje Prezesowi NBP informacje dotyczące zmian na liście uczestników prowadzonego systemu rozliczeń zgodnie z **Załącznikiem nr 3 - Uczestnicy**.

Poszczególne pola kolejnych formularzy należy wypełnić odpowiednio:

Formularz nr 1 - Dane identyfikujące sprawozdanie

Nazwa systemu – należy podać pełną nazwę prowadzonego przez podmiot systemu rozliczeń.

Rok – należy podać rok, którego dotyczy bieżąca sprawozdawczość (w formacie RRRR).

Kwartał – należy podać kwartał, którego dotyczy bieżąca sprawozdawczość (w formacie I kw., II kw., III kw. lub IV kw. dla odpowiednich kwartałów).

Formularz nr 2 - Lista uczestników systemu rozliczeń

Nazwa uczestnika – należy podać pełną nazwę uczestnika systemu rozliczeń.

Kod uczestnika – należy podać unikalny kod uczestnika systemu rozliczeń.

Lokalizacja siedziby spółki lub oddziału – należy wskazać lokalizację siedziby uczestnika systemu rozliczeń (w formacie miasto/kraj).

Obszar prowadzenia działalności przez uczestnika – należy wskazać rynek polski i/lub właściwy rynek zagraniczny (np. rynek brytyjski, rynek amerykański itd.).

Rodzaj prowadzonej działalności przez uczestnika – należy wskazać rodzaj prowadzonej działalności przez uczestnika systemu rozliczeń przypisany przez podmiot prowadzący ten system.

Typ uczestnictwa w systemie – należy wskazać typ uczestnictwa w systemie rozliczeń przypisany przez podmiot prowadzący ten system.

5. Procedura powiadamiania o gwarantowanej przepustowości

Podmiot prowadzący system rozliczeń przekazuje Prezesowi NBP informacje dotyczące aktualnej wartości gwarantowanej przepustowości systemu rozliczeń zgodnie z **Załącznikiem nr 4 - Przepustowość**.

Poszczególne pola kolejnych formularzy należy wypełnić odpowiednio:

Formularz nr 1 - Dane identyfikujące sprawozdanie

Nazwa systemu – należy podać pełną nazwę prowadzonego przez podmiot systemu rozliczeń.

Rok – należy podać rok, którego dotyczy bieżąca sprawozdawczość (w formacie RRRR).

Kwartał – należy podać kwartał, którego dotyczy bieżąca sprawozdawczość (w formacie I kw., II kw., III kw. Lub IV kw. Dla odpowiednich kwartałów).

Formularz nr 2 - Gwarantowana przepustowość systemu rozliczeń

Maksymalna liczba zrealizowanych transakcji w systemie w jednym dniu – należy podać aktualną maksymalną liczbę zrealizowanych transakcji, których rozliczenie jest możliwe w systemie rozliczeń w jednym dniu oraz datę początku okresu obowiązywania wprowadzonej zmiany.

Maksymalna liczba zrealizowanych transakcji w systemie w ciągu godziny – należy podać aktualną maksymalną liczbę zrealizowanych transakcji, których rozliczenie jest możliwe w systemie rozliczeń w ciągu godziny oraz datę początku okresu obowiązywania wprowadzonej zmiany.

6. Procedura powiadamiania o wynikach testów warunków skrajnych

Podmiot prowadzący system rozliczeń przekazuje Prezesowi NBP informacje dotyczące wyników testów warunków skrajnych przeprowadzonych w danym kwartale niezwłocznie po ich zakończeniu.