

Załącznik nr 1 do Uchwały Zarządu Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A.  
Nr 146/29/05/2019 z dnia 10 maja 2019 roku.



## **REGULAMIN KOMITETU DS. RYZYKA**

## **§ 1**

1. Niniejszy Regulamin Komitetu ds. Ryzyka („Regulamin”) określa zadania i szczegółowe zasady funkcjonowania Komitetu ds. Ryzyka powołanego przez Zarząd Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A. („IRGiT”), w tym jego skład oraz sposób powoływania i odwoływania jego członków.
2. Komitet ds. Ryzyka pełni funkcje opiniodawcze i doradcze wobec Zarządu IRGiT w sprawach dotyczących zarządzania ryzykiem związanym ze świadczeniem przez IRGiT usług rozliczeniowych. Prace Komitetu ds. Ryzyka mają na celu wymianę informacji między IRGiT a uczestnikami rynku.
3. Wszelkie zmiany do Regulaminu podejmowane są w formie uchwały Zarządu IRGiT.

## **I. ZADANIA KOMITETU**

### **§ 2**

1. Komitet pełni funkcje opiniodawcze i doradcze wobec IRGiT w sprawach dotyczących regulacji IRGiT lub uzgodnień, które:
  - a) mają wpływ na zarządzanie ryzykiem związanym ze świadczeniem przez IRGiT usług rozliczeniowych,
  - b) dotyczą bezpieczeństwa i efektywności prowadzenia rozliczeń, prawidłowego ustalania rodzaju i wielkości zabezpieczeń oraz formy ich wnoszenia,
  - c) dotyczą mechanizmów zarządzania ryzykiem związanym ze świadczeniem przez IRGiT usług rozliczeniowych oraz mechanizmów kontroli ryzyka.
2. W szczególności zadaniem Komitetu jest wypracowywanie i przedstawianie opinii w następujących obszarach:
  - a) zarządzanie przez IRGiT ryzykami powstającymi w związku z prowadzeniem rozliczeń, w tym dokonywanie wszechstronnych przeglądów modeli, metodologii oraz zasad przyjętych dla kwantyfikowania, grupowania i zarządzania tymi ryzykami oraz zasad zarządzania ryzykiem związanym z płynnością,
  - b) sprawy dotyczące regulaminów określających zasady i tryb rozliczania transakcji, regulaminu funduszu gwarancyjnego oraz uchwał wydanych na podstawie tych regulaminów,
  - c) kategorie podmiotów, które mogą ubiegać się o status członka rozliczającego oraz warunki członkostwa, które mają spełniać te podmioty,
  - d) procedury postępowania w razie wystąpienia przypadku niewykonania zobowiązania lub niewypłacalności albo konieczności wykorzystania środków systemu zabezpieczania płynności rozliczania transakcji,
  - e) regulacje wewnętrzne określające rodzaje skrajnych warunków rynkowych,
  - f) zbiór scenariuszy wykorzystywanych do identyfikowania skrajnych warunków rynkowych,
  - g) regulacje wewnętrzne określające zasady zarządzania ryzykiem utraty płynności, w tym plan zachowania płynności,

- h) testy warunków skrajnych i ich analiza.
- 3. Komitet przyjmuje opinię w omawianych sprawach poprzez aklamację.
- 4. W przypadku, gdy nie jest możliwe przyjęcie opinii zgodnie z ust. 3 opinie przyjmowane są bezwzględną większością głosów wszystkich członków Komitetu obecnych na posiedzeniu.
- 5. Opinia Komitetu powinna zawierać uzasadnienie.

## **II. SKŁAD KOMITETU I POWOŁYWANIE JEGO CZŁONKÓW**

### **§ 3**

- 1. W skład Komitetu ds. Ryzyka („Komitet”) wchodzi:
  - a) jeden reprezentant Towarzystwa Obrotu Energią z siedzibą w Warszawie,
  - b) jeden reprezentant Polskiego Towarzystwa Elektrociepłowni Zawodowych z siedzibą w Warszawie,
  - c) jeden reprezentant Towarzystwa Gospodarczego Polskie Elektrownie z siedzibą w Warszawie,
  - d) jeden reprezentant Izby Domów Maklerskich z siedzibą w Warszawie,
  - e) jeden reprezentant Izby Gospodarczej Gazownictwa z siedzibą w Warszawie,
  - f) jeden przedstawiciel Izby Energetyki Przemysłowej i Odbiorców Energii z siedzibą w Warszawie,
  - g) jeden przedstawiciel European Federation of Energy Traders z siedzibą w Amsterdamie,
  - h) maksymalnie dwóch reprezentantów innych stowarzyszeń lub organizacji zrzeszających członków Izby oraz ich klientów, przy czym jeden podmiot może posiadać jednego reprezentanta,
  - i) jeden przedstawiciel Towarowej Giełdy Energii S.A. z siedzibą w Warszawie,
  - j) jeden przedstawiciel IRGiT.
- 2. W posiedzeniach Komitetu, bez prawa głosu, mogą brać udział także członkowie Zarządu IRGiT oraz osoby zaproszone na posiedzenie przez Przewodniczącego Komitetu.
- 3. Członkowie Komitetu są powoływani w jego skład uchwałą Zarządu IRGiT, spośród kandydatów zgłoszonych przez podmioty, o których mowa w ust. 1. Kandydaci zgłaszani przez te podmioty powinni posiadać odpowiednią wiedzę i doświadczenie w zakresie zarządzania ryzykiem oraz funkcjonowania rynków towarów giełdowych.
- 4. Zgłoszenie kandydatów następuje w formie pisemnej wraz z wyrażoną przez nich pisemną zgodą na kandydowanie na członka Komitetu, według wzoru określonego w załączniku do niniejszego Regulaminu.
- 5. Brak zgłoszenia kandydata przez którykolwiek z podmiotów wskazanych w ust. 1, nie wpływa na prawidłowe wykonywanie funkcji przez Komitet.

### **§ 4**

1. Członek Komitetu może złożyć rezygnację z członkostwa w Komitecie na ręce Przewodniczącego Komitetu. Rezygnacje składane są w formie pisemnej.
2. Członkowie Komitetu mogą być odwołani ze swojej funkcji na wniosek podmiotów, które zgłosiły ich kandydaturę na członka Komitetu. Wniosek wymaga formy pisemnej i składany jest na ręce Przewodniczącego Komitetu.
3. Członkostwo w Komitecie wygasa z dniem przyjęcia przez Zarząd IRGiT w formie uchwały rezygnacji z pełnienia funkcji członka Komitetu lub jego odwołania.
4. Zarząd IRGiT na wniosek Przewodniczącego Komitetu ma prawo w każdym czasie odwołać członka Komitetu w formie uchwały przekazując pisemne oświadczenie wraz z uzasadnieniem swojej decyzji do podmiotu, który zgłosił danego członka Komitetu. Data odwołania podana będzie w uchwale Zarządu IRGiT.
5. W przypadku zakończenia pełnienia funkcji przez danego członka Komitetu, podmiot który zgłosił jego kandydaturę powinien niezwłocznie wskazać nowego kandydata na zasadach określonych w § 3 ust. 4.

## **§ 5**

1. IRGiT upublicznia skład Komitetu oraz treść Regulaminu na stronie internetowej IRGiT.
2. Członkowie Komitetu nie otrzymują od IRGiT wynagrodzenia z tytułu wykonywania obowiązków związanych z działalnością Komitetu.

## **III. ORGANIZACJA KOMITETU**

### **§ 6**

1. Przewodniczącego Komitetu powołuje i odwołuje Zarząd IRGiT w formie Uchwały.
2. Pracami Komitetu kieruje Przewodniczący Komitetu. W przypadku nieobecności Przewodniczącego Komitetu, jego obowiązki wykonuje osoba wskazana przez Zarząd IRGiT w formie pisemnej.
3. Do obowiązków Przewodniczącego należy w szczególności:
  - a) zwoływanie posiedzeń, organizacja prac i przewodniczenie obradom Komitetu,
  - b) zapraszanie gości na posiedzenia Komitetu,
  - c) dbanie o przestrzeganie przepisów Regulaminu przez Komitet,
  - d) reprezentowanie Komitetu wobec organów IRGiT oraz osób trzecich,
  - e) podpisywanie stanowisk i opinii w imieniu Komitetu.
4. IRGiT zapewnia obsługę administracyjną Komitetu, w szczególności poprzez delegowanie osoby odpowiadającej za obsługę organizacyjną, w tym dokumentowanie prac lub stanowisk i opinii przyjmowanych przez Komitet oraz tworzenie protokołów z posiedzeń Komitetu. Osoba ta nie staje się członkiem Komitetu, w szczególności nie ma prawa głosu.
5. IRGiT zapewnia wsparcie merytoryczne Komitetu, w szczególności poprzez przygotowywanie obliczeń, prezentacji i analiz na posiedzenia Komitetu.

## **§ 7**

1. Członkowie Komitetu wykonują swoje prawa i obowiązki osobiście.
2. Członkowie Komitetu są obowiązani wskazać Przewodniczącemu Komitetu adresy elektroniczne, pod które powinny być im przesyłane wszystkie informacje związane z ich członkostwem w Komitecie. Członkowie Komitetu mają obowiązek informować Przewodniczącego Komitetu o każdej zmianie wskazanych przez nich adresów.

## **§ 8**

1. Komitet odbywa posiedzenia, z częstotliwością umożliwiającą prawidłowe wykonywanie jego zadań, jednak nie rzadziej niż raz na pół roku.
2. Posiedzenie zwołuje Przewodniczący Komitetu poprzez wysłanie członkom Komitetu, na wskazany przez nich adres elektroniczny, z co najmniej tygodniowym wyprzedzeniem, miejsca, terminu oraz porządku obrad. Informacja o zwołaniu posiedzenia i porządek obrad przekazywana jest do wiadomości Zarządu IRGiT. W uzasadnionych przypadkach członkowie Komitetu mogą uczestniczyć w posiedzeniu Komitetu z wykorzystaniem środków porozumiewania się na odległość.
3. Posiedzenie Komitetu zwołane na zasadach określonych w ust. 2 jest ważne niezależnie od ilości członków Komitetu obecnych na tym posiedzeniu.

## **§ 9**

1. Posiedzenia Komitetu są protokołowane.
2. Protokół powinien stwierdzać miejsce i czas posiedzenia oraz porządek obrad, imiona i nazwiska osób obecnych na posiedzeniu, a także zawierać podsumowanie zagadnień będących przedmiotem obrad posiedzenia, w tym przyjęte przez Komitet opinie.
3. Ostateczna treść protokołu uzgadniana jest w następującym trybie:
  - a) w ciągu 7 dni roboczych po odbyciu posiedzenia członkowie Komitetu otrzymają pocztą elektroniczną wersję roboczą protokołu,
  - b) składanie uwag do wersji roboczej protokołu odbywa się w ciągu kolejnych 7 dni roboczych od daty jej wysłania,
  - c) na podstawie wersji roboczej i otrzymanych uwag sporządzana jest ostateczna wersja protokołu,
  - d) ostateczna wersja protokołu, po podpisaniu przez Przewodniczącego Komitetu, jest rozsyłana do wszystkich członków Komitetu i Zarządu IRGiT.

## **§ 10**

1. Z zastrzeżeniem obowiązujących przepisów prawa, członkowie Komitetu mają obowiązek zachowania poufności informacji uzyskanych w związku z członkostwem w Komitecie.

2. Przewodniczący Komitetu poucza osoby biorące udział w posiedzeniach Komitetu bez prawa głosu, o obowiązku zachowania poufności informacji uzyskanych w trakcie posiedzenia Komitetu.

## **ZGŁOSZENIE KANDYDATA NA CZŁONKA KOMITETU DO SPRAW RYZYKA PRZY IZBIE ROZLICZENIOWEJ GIEŁD TOWAROWYCH S.A. Z SIEDZIBĄ W WARSZAWIE**

(nazwa podmiotu) zgłasza Panią/Pana (imię i nazwisko) jako swojego Reprezentanta w Komitecie ds. Ryzyka przy Izbie Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A.

(nazwa podmiotu) zobowiązuje się do przestrzegania Regulaminu Komitetu ds. Ryzyka przyjętego przez Izbę Rozliczeniową Giełd Towarowych S.A., a w szczególności do przestrzegania zasad dotyczących zasad zachowania poufności, o których mowa w tym Regulaminie.

.....  
(data i podpisy zgodnie z reprezentacją podmiotu)

Imię i nazwisko Reprezentanta: .....

Telefon: .....

e-mail: .....

### **OŚWIADCZENIE**

Niniejszym wyrażam zgodę na powołanie mnie na Członka Komitetu ds. Ryzyka przy Izbie Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A. i zobowiązuję się do przestrzegania Regulaminu Komitetu ds. Ryzyka, a w szczególności do zachowania poufności wewnętrznych dokumentów Komitetu ds. Ryzyka oraz informacji z nimi związanych, jak również innych informacji uzyskanych w ramach prac Komitetu ds. Ryzyka.

Wyrażam zgodę na przetwarzanie moich danych osobowych przez Izbę Rozliczeniową Giełd Towarowych S.A. z siedzibą w Warszawie (ul. Książęca 4, 00-498 Warszawa), zgodnie z Ustawą z dnia 29 sierpnia 1997 r. o ochronie danych osobowych (Dz.U. z 2016 r., poz. 922 z późn. zm.) w celu organizacji i realizacji prac Komitetu ds. Ryzyka. Jednocześnie wyrażam zgodę na upublicznienie mojego imienia oraz nazwiska na stronie internetowej Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A.

.....  
(data i podpis Reprezentanta)

#### ***Klauzula informacyjna***

*Administratorem powyższych danych osobowych jest Izba Rozliczeniowa Giełd Towarowych S.A. z siedzibą w Warszawie, ul. Książęca 4, 00-498 Warszawa, zarejestrowana w rejestrze przedsiębiorców prowadzonym przez Sąd Rejonowy dla m. st. Warszawy, XII Wydział Gospodarczy Krajowego Rejestru Sądowego, pod nr KRS 0000321809, NIP 525-244-16-34, kapitał zakładowy 44.805.000 zł (wpłacony w całości).*

*Celem zbierania danych jest organizacja i realizacja prac Komitetu ds. Ryzyka przy Izbie Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A.*

*Przysługuje Pani/Panu prawo dostępu do treści danych oraz ich sprostowania, usunięcia lub ograniczenia przetwarzania, a także prawo sprzeciwu, zażądania zaprzestania przetwarzania i przenoszenia danych, jak również prawo do cofnięcia zgody w dowolnym momencie oraz prawo do wniesienia skargi do właściwego organu nadzorczego.*

*Podanie danych jest dobrowolne, lecz niezbędne do powołania na Członka Komitetu ds. Ryzyka.*

*Dane osobowe będą przechowywane przez okres pełnienia funkcji Członka Komitetu ds. Ryzyka oraz po jego zakończeniu w celu wypełnienia obowiązku prawnego ciążącego na Administratorze, na czas zgodny z obowiązującymi przepisami.*