

Załącznik nr 1 do Uchwały Zarządu Izby Rozliczeniowej Giełd Towarowych S.A.
Nr 193/58/07/2018 z dnia 20 lipca 2018 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) maksymalnie dwóch reprezentantów innych stowarzyszeń lub organizacji zrzeszających członów Izby oraz ich klientów, przy czym jeden podmiot może posiadać jednego reprezentanta,
 - g) jeden przedstawiciel Towarowej Giełdy Energii S.A. z siedzibą w Warszawie,
 - h) 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 odpowiedzialnej 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.