

„Wybrane obowiązki kontrahentów finansowych wynikające z rozporządzenia EMIR – obowiązek rozliczania derywatów OTC oraz obowiązek stosowania technik ograniczania ryzyka dla transakcji rozliczanych dwustronnie”

Data: 8 listopada 2017 roku (środa)

Miejsce: Centrum Konferencyjno-Szkoleniowe UOKiK,
Pl. Powstańców Warszawy 1, Warszawa

Cel

Celem seminarium jest przedstawienie problematyki obowiązków rozliczania derywatów OTC oraz obowiązku stosowania technik ograniczania ryzyka dla transakcji rozliczanych dwustronnie, wynikających z rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji (EMIR) oraz aktów wykonawczych EMIR.

Kto powinien wziąć udział?

Seminarium skierowane jest do kontrahentów finansowych, którzy zawierają transakcje na instrumentach pochodnych OTC i zobowiązani są do centralnego rozliczania derywatów OTC lub do stosowania technik ograniczania ryzyka dla derywatów rozliczanych dwustronnie. W zależności od liczby dostępnych miejsc w seminarium mogą wziąć udział kontrahenci niefinansowi objęci powyższymi obowiązkami.

Forma

Seminarium będzie miało formę prezentacji połączonej z dyskusją.

Harmonogram czasowy

Rejestracja uczestników na seminarium rozpocznie się od godziny **9.30**

Rozpoczęcie seminarium o godzinie **10.00**

Seminarium zakończy się o godzinie **16.00**

Zgłoszenia: liczba miejsc ograniczona

Zgłoszenia będą przyjmowane wyłącznie za pośrednictwem elektronicznego formularza zgłoszeniowego dostępnego pod adresem www.knf.gov.pl w dziale „CEDUR” aż do wyczerpania miejsc. Potwierdzenia uczestnictwa zostaną przesłane najpóźniej **w dniu 6 listopada 2017 roku**.

Kontakt:

Anna Rojek tel. (22) 262 48 59

Anna Smyk-Latoszek tel. (22) 262 41 22

cedur@knf.gov.pl

Opłaty

Udział w seminarium jest **bezpłatny**. Uczestnicy otrzymają materiały konferencyjne.

PROGRAM

8 listopada 2017 roku

„Wybrane obowiązki kontrahentów finansowych wynikające z rozporządzenia EMIR – obowiązek rozliczania derywatów OTC oraz obowiązek stosowania technik ograniczania ryzyka dla transakcji rozliczanych dwustronnie”

| Godzina | Temat |
|-------------|--|
| 9:30-10:00 | Rejestracja uczestników |
| 10:00-10:15 | Uroczyste otwarcie |
| 10:15-11:00 | <p>Szczegółowa charakterystyka wybranych aspektów centralnego rozliczania transakcji na instrumentach pochodnych OTC</p> <ul style="list-style-type: none"> – Modyfikacja definicji derywatów OTC na potrzeby EMIR w związku z MiFID2/MiFIR – Terminy wejścia w życie obowiązków dotyczących centralnego rozliczania dla poszczególnych klas instrumentów pochodnych – 4 kategorie kontrahentów w RTS dotyczące klas derywatów objętych obowiązkiem centralnego rozliczania – Frontloading w zakresie rozliczania – Rejestr publiczny ESMA – Rodzaje centralnego rozliczania (uczestnik, client clearing, indirect clearing) – Obowiązki uczestnika rozliczającego i pośredniego uczestnika rozliczającego – Segregacja aktywów i pozycji oraz typy kont rozliczeniowych – Wyłączenia z obowiązku centralnego rozliczania dla transakcji wewnątrzgrupowych – Raportowanie jako nierozłączny element związany z rozliczaniem (w tym nowe zasady odrzucania przez Repozytoria Transakcji od 1.11.2017 r. raportów bez wymaganego kodu LEI) <p><i>Bogusław Budziński</i> <i>Departament Firm Inwestycyjnych i Infrastruktury Rynku Kapitałowego</i> <i>Urząd Komisji Nadzoru Finansowego</i></p> |

| | |
|---------------------------|---|
| <p>11:00-12:00</p> | <p>Szczegółowa charakterystyka wybranych aspektów zabezpieczania ryzyka transakcji na instrumentach pochodnych OTC rozliczanych bilateralnie</p> <ul style="list-style-type: none"> – Codzienna wycena – Potwierdzanie transakcji – Raportowanie do nadzoru transakcji niepotwierdzonych – Rekoncyliacja i kompresja portfela – Rozwiązywanie sporów – Obowiązek wymiany zabezpieczeń (RTS 2016/2251) <p><i>Bogusław Budziński</i> <i>Departament Firm Inwestycyjnych i Infrastruktury Rynku Kapitałowego</i> <i>Urząd Komisji Nadzoru Finansowego</i></p> |
| <p>12:00-12:15</p> | <p>Bufet kawowy</p> |
| <p>12:15-13:15</p> | <p>Charakterystyka usług KDPW_CCP w zakresie centralnego rozliczania transakcji OTC – cz. I</p> <ul style="list-style-type: none"> – Rodzaje transakcji objętych centralnym rozliczeniem – Proces rozliczenia transakcji, rola CCP – Segregacja aktywów banków i ich klientów – Model zabezpieczeń <p><i>Żaneta Skorupska-Świrska – Zastępca Dyrektora Zarządzającego</i> <i>KDPW_CCP S.A.</i></p> |
| <p>13:15-14:15</p> | <p>Bufet kawowy</p> |
| <p>14:15-15:15</p> | <p>Charakterystyka usług KDPW_CCP w zakresie centralnego rozliczania transakcji OTC – cz. II</p> <ul style="list-style-type: none"> – Monitoring wymagań depozytowych – Kompresja pozycji przeciwstawnych – Proces aukcji pozycji – Raportowanie transakcji do repozytorium <p><i>Żaneta Skorupska-Świrska – Zastępca Dyrektora Zarządzającego</i> <i>KDPW_CCP S.A.</i></p> |
| | |

| | |
|--------------------|---|
| 15:15-16:00 | Charakterystyka usług KDPW w zakresie zabezpieczania transakcji rozliczanych bilateralnie <ul style="list-style-type: none">– Ustanawianie zabezpieczeń w papierach wartościowych – założenia ogólne– Główne cele usługi oferowanej przez Krajowy Depozyt– Ustanawianie blokady papierów wartościowych oraz zwolnienie blokady– Przejęcie zabezpieczenia <p><i>Krzysztof Ołdak – Dyrektor Działu Operacyjnego Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.</i></p> |
| | |