Załącznik 1. Ankieta due diligence

[**nazwa podmiotu**]

z siedzibą w [*miejscowość*], ul. [*ulica, numer, kod*], zarejestrowana w Krajowym Rejestrze Sądowym prowadzonym przez Sąd [*nazwa*], pod numerem [*numer KRS*], kod LEI [*numer*]

**OŚWIADCZA, IŻ:**

1. zapoznał się, rozumie i zobowiązuje się stosować Regulamin Rynku Treasury BondSpot Poland, w brzmieniu określonym Uchwałą Zarządu nr 22/25 z dnia 20 lutego 2025 r. (tekst ujednolicony obowiązujący na dzień 1 kwietnia 2025)[[1]](#footnote-1).
2. Jest[[2]](#footnote-2)

instytucją działającą na terytorium Unii Europejskiej,

instytucją upoważnioną do świadczenia usług określonych w sekcji A załącznika I do Dyrektywy 2014/65/UE Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 15 maja 2014 r. (dalej zwanej „Dyrektywą”), objętą nadzorem właściwych organów nadzoru, mogącą działać na Rynku Treasury BondSpot Poland,

firmą inwestycyjną, prowadzącą działalność, o której mowa w sekcji A pkt 3. Załącznika I w rozumieniu Dyrektywy,

instytucją kredytową, prowadzącą działalność, o której mowa w sekcji A pkt 3. Załącznika I w rozumieniu Dyrektywy,

instytucją upoważnioną do działania na Rynku na innej podstawie niż sekcja A pkt 3 Załącznik I Dyrektywy (na jakiej?) ………………………………………..;

1. posiada kapitały własne obliczone zgodnie z obowiązującymi ją przepisami sprawozdawczymi o wartości …………………………….(stan na dzień ……) lub ich ekwiwalent wyliczony zgodnie z właściwymi przepisami;
2. posiada odpowiednie środki organizacyjne i techniczne pozwalające na poprawne działanie na Rynku i wykonywanie zobowiązań wynikających z realizacji zawartych transakcji;
3. zapewnia ciągłość obsługi oraz pracy urządzeń i systemów teleinformatycznych wykorzystywanych w prowadzonej działalności, aby sprostać wszelkim awariom swoich systemów transakcyjnych oraz zapewnia kompleksowe testowanie i właściwe monitorowanie swoich systemów, w tym w szczególności:
4. zapewnia odporność i wydajność urządzeń i systemów teleinformatycznych   
   w stopniu odpowiadającym skali prowadzonej działalności na Rynku;
5. zapobiega nieprawidłowemu wpływowi urządzeń i systemów teleinformatycznych na sprawny i bezpieczny obrót SPW na Rynku, w szczególności przez kierowanie błędnych zleceń;
6. dokonuje badania zleceń oraz zawieranych przez siebie transakcji, pod kątem wykrywania nadużyć na rynku, w szczególności możliwości dokonania manipulacji kursami instrumentów finansowych notowanych na TBSP oraz instrumentów powiązanych, jak również uniemożliwia wykorzystywanie urządzeń i systemów teleinformatycznych w sposób naruszający przepisy *Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 596/2014 z dnia 16 kwietnia 2014 r. w sprawie nadużyć na rynku (rozporządzenie w sprawie nadużyć na rynku MAR).*
7. w przypadku zleceń składanych przy wykorzystaniu handlu algorytmicznego przestrzega wymagań dotyczących stosowanego handlu algorytmicznego, w szczególności:
8. potwierdza, iż przed wdrożeniem lub istotną aktualizacją algorytmu stosowanego na TBSP, algorytm ten został przetestowany w celu uniknięcia możliwości przyczyniania się do zakłóceń obrotu
9. Spośród zidentyfikowanych w obrocie na TBSP short code proszę wskazać czy jest to short code przypisany do algorytmu, jeżeli tak to proszę wskazać czy i kiedy został przetestowany, zgodnie z obowiązującymi przepisami prawa

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Short code** | **Typ short code**  **(algo / nie-algo)** | **Czy algorytm został przetestowany?**  **Data ostatniego testowania algorytmu** |
|  |  |  |

1. opracował, wdrożył i stosuje zasady i procedury oraz środki kontroli i mechanizmy określone w art. 1-18 *Rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/589 z dnia 19 lipca 2016 r. uzupełniającego dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających wymogi organizacyjne dla firm inwestycyjnych prowadzących handel algorytmiczny*, obejmujące m.in. środki kontroli przedtransakcyjnej, środki kontroli potransakcyjnej oraz monitoring aktywności inwestycyjnej w czasie rzeczywistym

**dotyczy / nie dotyczy \***

1. zatrudnia odpowiednio wykwalikowane osoby na kluczowych stanowiskach do prowadzenia działalności na Rynku, adekwatnych do zakresu prowadzonej działalności;
2. przeprowadził proces samooceny i walidacji zgodnie z Artykułem 9 Rozporządzenia Delegowanego Komisji (UE) 2017/589.

**dotyczy / nie dotyczy \***

1. sprawozdanie z walidacji zostało zaudytowane przez komórkę ds. audytu wewnętrznego

**tak / nie / nie dotyczy \***

Uwagi do oświadczeń i przekazanych informacji

………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………………

Podpis

………………..………………………………………………………

Imię i nazwisko osoby upoważnionej do reprezentacji

…………………………..……………………………………………

Data złożenia oświadczenia

…………………………..……………………………………………

*\* Niepotrzebne skreślić*

1. Źródło: strona internetowa BondSpot, https://www.bondspot.pl/regulacje\_TBSPoland. [↑](#footnote-ref-1)
2. Zaznaczyć odpowiednio. [↑](#footnote-ref-2)