

Załącznik E – Harmonogram Dnia Obrotu

I. Postanowienia ogólne

Harmonogram Dnia Obrotu ustalony jest zgodnie z czasem środkowoeuropejskim.

II. Transakcje rynku kasowego

- 8:30-8:55** - Faza operacji przedrynkowych, w trakcie której tylko Market Makerzy mogą działać na Rynku. W tym czasie Market Makerzy mogą składać, modyfikować, zawieszać swoje Oferty. Każdy Market Maker widzi tylko własne Oferty. Nie dokonuje się kojarzenia Ofert.
- 8:55-9:00** - Faza wstępna rynku, w trakcie której wszyscy Uczestnicy mogą działać zgodnie z wyznaczonym dla siebie profilem działania. W czasie fazy wstępnej w szczególności:
 - 1) Uczestnicy mogą składać Oferty,
 - 2) Automatyczne kojarzenie Ofert jest nieaktywne,
 - 3) Udostępniana jest strona „Best Page” i wyliczane są aktualne podsumowania,
 - 4) Uczestnicy mogą przysyłać Dyspozycje,
 - 5) Dyspozycje, dla których w Systemie dostępna jest strona przeciwna oraz spełniają one warunki strony przeciwnej, oraz dla których wartość nominalna SPW będących jej przedmiotem jest równa bądź wyższa niż minimalna jednostka obrotu dla danego rodzaju SPW są automatycznie potwierdzane przez system,
 - 6) Market Makerzy mogą zdecydować czy potwierdzić transakcję, której wartość jest niższa niż minimalna jednostka obrotu dla danego rodzaju SPW
- 9:00-17:00** – Rynek otwarty, w czasie tej fazy wszyscy Uczestnicy mogą działać na Rynku, zgodnie z wyznaczonym dla siebie profilem działania. W tym czasie Uczestnicy mogą składać, modyfikować, zawieszać i reaktywować swoje Oferty oraz wysyłać Dyspozycje.

System przesyła komunikaty sygnalizujące Uczestnikom rozpoczęcie fazy rynku otwartego. W tym momencie następuje usunięcie Ofert z rynku (blackout), automatyczne kojarzenie w Systemie złożonych Ofert i Dyspozycji oraz niezwłoczna aktualizacja strony „Best Page”.

W tej fazie rynku możliwe jest automatyczne kojarzenie Ofert i Dyspozycji lub dwóch Ofert i zawieranie transakcji rynku kasowego.

Transakcje Mid Price realizowane są w godzinach 9:30 - 17:00.

Sesje Mid Price Fixing rozpoczynają się o godzinie: 9.45, 10.45, 11.45, 12.45, 13.45, 14.45, 15.45, 16.45 i trwają 5 minut.

- 17:00-19:00** – Rynek zamknięty, w czasie tej fazy rynek jest nieaktywny. W tym czasie Uczestnicy mogą tylko przysyłać i odbierać komunikaty, sprawdzać statystyki dotyczące transakcji dnia, otrzymywać raporty, wykazy, indeksy i pobierać nowe wersje oprogramowania peryferyjnego.

III. Transakcje rynku repo

- 7:45-16:45** - Na rynku repo możliwe jest zawieranie transakcji warunkowych repo z zastrzeżeniem, że transakcja warunkowa repo, której transakcja otwierająca rozliczana w terminie T+0, gdzie T oznacza dzień zawarcia transakcji, może być zawarta do godziny 14:15.
- 16:45-19:00** – Rynek zamknięty.

Załącznik F – Dni Obrotu

1. Obrót na Rynku odbywa się w Dniach obrotu tj. od poniedziałku do piątku, z wyłączeniem następujących dni:
 - 1) 1 stycznia,
 - 2) 6 stycznia,
 - 3) Wielki Piątek,
 - 4) Drugi Dzień Wielkiej Nocy,
 - 5) 1 maja,
 - 6) 3 maja,
 - 7) dzień Bożego Ciała,
 - 8) 15 sierpnia,
 - 9) 1 listopada,
 - 10) 11 listopada,
 - 11) 24 grudnia,
 - 12) 25 grudnia,
 - 13) 26 grudnia,
 - 14) 31 grudnia.

Każdego roku Spółka udostępnia Uczestnikom informację o datach na które przypadają święta ruchome z co najmniej 10 dniowym wyprzedzeniem.

2. Zarząd określa dodatkowe dni, w których nie będzie odbywał się obrót na Rynku.
3. Spółka poinformuje Emitenta, Narodowy Bank Polski, Instytucję Rozliczeniową i Uczestników o dodatkowych dniach, w których nie będzie odbywał się obrót z wyprzedzeniem co najmniej 10 Dni Obrotu, w sposób przyjęty przez Spółkę.
4. Market Maker zwolniony jest z obowiązku kwotowania, o którym mowa w § 14 ust. 1 lit. b) Regulaminu, w takie dni, które są ustalone jako publiczne święta w kraju tego Uczestnika, o ile nie stoi to w sprzeczności z jego zobowiązaniem do wypełniania tych obowiązków.