

DO/ZW/3159/2011

Warszawa, 24 listopada 2011 r.

Uczestnicy KDPW

W nawiązaniu do przekazanych Państwu pism z dnia 26 kwietnia br. (sygn.: SCP/ZW/15/2011) oraz 8 czerwca br. (sygn.: SCP/ZW/33/2011), uprzejmie informujemy, że 15 grudnia br. rozpocznie się II etap testów związanych ze zmianami realizowanymi w ramach projektu Hold-Release. Testy będą obejmowały następujące funkcjonalności (zagadnienia):

1. mechanizm „Hold-Release”, czyli możliwość wstrzymywania i zwalniania instrukcji,
2. rezygnacja z funkcjonalności instrukcji wstępnych,
3. standaryzacja kodów statusów instrukcji rozrachunku,
4. „ukrycie” technicznej instrukcji rozrachunku,
5. nowa metodologia w zakresie stosowania przedziałów tolerancji,
6. wskazywanie identyfikatora konta podmiotowego w komunikacie sese.tec.001.02,
7. informowanie o przyczynach braku zestawiania w komunikacie statusu instrukcji,
8. stosowanie identyfikatora klienta w procesie zestawiania instrukcji rozrachunku.

Zakończenie testów przewidujemy w dniu 23 stycznia 2012 r.

Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.
ul. Książęca 4
00-498 Warszawa
T 22 537 93 43
F 22 627 31 11
E kdpw@kdpw.pl
www.kdpw.pl

Termin wdrożenia ww. zmian uzależniony jest od terminu zakończenia procesu legislacyjnego zmian w regulacjach KDPW. W chwili obecnej planowany termin implementacji zmian został wyznaczony na dzień 1 lutego 2012 r.

W celu przeprowadzenia testów od dnia 15 grudnia br., udostępnimy Państwu środowisko testowe TST B na zasadach określonych w załączniku do niniejszego pisma.

Struktury zmienionych komunikatów oraz zaktualizowane opisy pól dostępne są na stronie www.kdpw.pl w zakładce: Uczestnicy/wymogi technologiczne/Planowane zmiany.

Korespondencję dotyczącą testów prosimy kierować na adres elektroniczny: di_serwis@kdpw.pl.

Z poważaniem,

Krzysztof Ołdak

Dyrektor Działu Operacyjnego

Załącznik - Założenia dotyczące II etapu testów w ramach projektu Hold-Release

Załącznik

Założenia dotyczące II etapu testów w ramach projektu Hold-Release

1. Testy będą odbywać się w dniach 15.12.2011 r. – 23.01.2012 r. w środowisku testowym TST B.
2. Rozrachunek będzie dokonywany w ramach 2 sesji technicznych i 3 sesji regularnych, wg następującego harmonogramu dnia księgowego:

Nr sesji rozrachunkowej	Godz. rozpoczęcia sesji	Rodzaje przetwarzanych dokumentów
R	9.00	Sesja techniczna
1	10.00	Sesja regularna – wszystkie operacje
2	12.30	Sesja regularna – wszystkie operacje
3	15.00	Sesja regularna – wszystkie operacje
W	15.15	Sesja techniczna

3. Rozrachunek w systemie rozrachunków w czasie rzeczywistym będzie prowadzony w godzinach od 9.00 do 15.00.
4. Rozrachunek transakcji będzie następował przy założeniu pełnego pokrycia w środkach pieniężnych – nie przewiduje się wykorzystywania połączenia z bankiem rozliczeniowym.
5. Testy będą obejmowały następujące obszary:

5.1. Mechanizm „Hold-Release”, czyli możliwość wstrzymywania i zwalniania instrukcji

Opis zmiany

Wprowadzono możliwość wielokrotnego wstrzymywania i zwalniania instrukcji skierowanych do RTGS oraz możliwość przejścia ze stanu „Hold” na „Release” w przypadku instrukcji skierowanych do systemu wielosesyjnego. Funkcjonalność ta będzie miała zastosowanie tylko w przypadku instrukcji rozrachunku podlegających procesowi zestawiania.

Zakres testów

W ramach testu należy przelać instrukcje rozrachunku z różnymi wartościami pola FuncOfMsg. Podanie wartości NEWM w tym polu będzie oznaczało skierowanie instrukcji do rozrachunku („Release”), natomiast wartość PREA będzie oznaczała wstrzymanie rozrachunku („Hold”). Zmiana statusu pierwotnie przesłanej instrukcji będzie mogła być realizowana poprzez wykorzystanie komunikatu sese.tec.001.02. Wpisanie nowego kodu operacji w polu OprCd o wartości SETT oraz typu operacji w polu OprTp o wartości:

- YPRE – będzie oznaczało skierowanie instrukcji do rozrachunku, funkcja Release,
- NPPE - będzie oznaczało wstrzymanie rozrachunku, funkcja Hold.

Granicznym punktem, do którego będzie można wstrzymywać, bądź zwalniać instrukcje w systemie RTGS będzie moment skierowania instrukcji do rozrachunku w systemie RTGS, natomiast w przypadku systemu MB, granicznym punktem do którego będzie można zwolnić

instrukcję rozrachunku, będzie początek sesji rozrachunkowej. Uczestnicy każdorazowo będą informowani o zmianie statusu instrukcji w związku z przesłaniem przez siebie lub kontrpartniera instrukcji modyfikującej.

5.2. Rezygnacja z funkcjonalności instrukcji wstępnych (dotyczy również instrukcji dla rynku derywatów)

Opis zmiany

Funkcjonalność „Pre-matching”, czyli obsługa wstępnych instrukcji rozrachunku została zastąpiona mechanizmem „Hold-Release” (mechanizm „Hold-Release nie dotyczy rynku derywatów).

5.3. Standaryzacja kodów statusów instrukcji rozrachunku (dotyczy również instrukcji dla rynku derywatów)

Opis zmiany

Wprowadzono nowe statusy i kody przyczyn instrukcji rozrachunku (patrz: załącznik nr 2 ww. pisma z dn. 8.06.2011 r.) oraz nowe pole HldInd (Hold Indicator) wskazujące informacje o stanie instrukcji w zakresie Hold/Release.

Zakres testów

W ramach testu należy przesłać wraz z kontrpartnerem transakcji instrukcje rozrachunku wymagające zestawienia. Każda ze stron transakcji otrzyma statusy do instrukcji źródłowej w nowej wersji komunikatu statusowego sese.sts.001.03. Komunikat ten został również rozszerzony o pole HldInd (Hold Indicator) wskazujące informacje o stanie instrukcji w zakresie Hold/Release.

5.4. „Ukrycie” technicznej instrukcji rozrachunku (dotyczy również instrukcji dla rynku derywatów)

Opis zmiany

Komunikaty zawierające status instrukcji (nowa wersja specyfikacji komunikatu: sese.sts.001.03) oraz wyciąg z konta (komunikat semt.smt.001.02) będą zawsze dotyczyły instrukcji źródłowych.

5.5. Nowa metodologia wyznaczenia przedziałów tolerancji

Opis zmiany

Przyjęto nowe przedziały tolerancji, które będą wynosić:

- 8 zł dla transakcji o wartości do 400 000 PLN,
- 100 zł dla transakcji o wartości przekraczających 400 000 PLN.

Zakres testów

W ramach testu należy przesłać wraz z kontrpartnerem transakcji instrukcje rozrachunku wymagające zestawienia, z różną wartością rozrachunku. W przypadku gdy różnica wartości rozrachunku obu instrukcji nie przekracza wyznaczonych przedziałów, obowiązująca wartość transakcji będzie pobrana z instrukcji przesłanej przez sprzedającego. Jednocześnie nastąpi likwidacja stosowania różnych limitów tolerancji w zależności od rodzaju transakcji.

5.6. Wskazywanie identyfikatora konta podmiotowego w komunikacie sese.tec.001.02 (dotyczy również instrukcji dla rynku derywatów)

Opis zmiany

Umożliwiono opcjonalne wskazywanie w instrukcji technicznej identyfikatora konta podmiotowego (nowa wersja komunikatu technicznego sese.tec.001.02).

5.7. Informowanie o przyczynach braku zestawiania w komunikacie statusu instrukcji (dotyczy również instrukcji dla rynku derywatów)

Opis zmiany

Wprowadzono nową funkcjonalność systemu kdpw_stream polegającą na informowaniu (w przypadku braku zestawienia) uczestników o kodzie przyczyny braku zestawienia dwóch instrukcji (patrz: załącznik nr 3 ww. pisma z dn. 8.06.2011 r.). Informacja taka będzie przekazywana wyłącznie po znalezieniu przez system instrukcji „podobnych” tzn. w przypadku wystąpienia tylko jednej niezgodności pomiędzy porównywanymi instrukcjami. Zwracamy Państwa uwagę na fakt, iż zasady informowania o instrukcjach podobnych nie dotyczą zestawiania trójstronnego.

Zakres testów

W ramach testu należy przesłać wraz z kontrpartnerem transakcji instrukcje rozrachunku wymagające zestawienia, różniące się wyłącznie wartością jednego pola. Brak zgodności nie dotyczy pól:

- kod uczestnika rozliczającego po stronie dostarczającej i przyjmującej
- data rozrachunku
- status instrukcji.

W odpowiedzi strony transakcji otrzymają komunikat statusu zawierający w polu: *RsnTxt* w sekcji *Rsn* (Reason) wartość niezgodnego pola podanego przez kontrpartniera.

5.8. Stosowanie identyfikatora klienta w procesie zestawiania instrukcji rozrachunku

Opis zmiany

Wprowadzono możliwość użycia identyfikatora klienta jako dodatkowego kryterium zestawiania instrukcji.

Zakres testów

W ramach testu należy przestać wraz z kontrpartnerem transakcji instrukcje z wypełnionym polem klient w postaci kodu BIC lub identyfikatora konta. Instrukcje zostaną zestawione w przypadku wypełnienia pola klient tylko przez jedną ze stron, jak również gdy obie strony nie wypełnią tych pól. Zwracamy Państwa uwagę na fakt, iż w przypadku gdy jeden z uczestników wskaże kod BIC klienta, a drugi identyfikator konta i kod własny, instrukcje nie zostaną zestawione.