

Warszawa, 8 maja 2017 r.

Uczestnicy KDPW
Uczestnicy Repozytorium Transakcji
Uczestnicy KDPW_CCP
Podmioty zainteresowane

Dot. usługi ARM

Szanowni Państwo,

w nawiązaniu do dotychczasowej korespondencji dotyczącej planów uruchomienia przez Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych (KDPW) usługi Approved Reporting Mechanism (ARM), a więc pośrednictwa w przekazywaniu do organów nadzoru informacji wymaganych od firm inwestycyjnych, zgodnie z art. 26 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych zmieniającego rozporządzenie (EU) nr 648/2012 (MIFIR), przedstawiamy Państwu materiał opisujący założenia przyjęte przez KDPW w zakresie sposobu realizacji tej usługi.

KDPW, jako centralny depozyt papierów wartościowych, oferuje szereg komplementarnych usług, w szczególności pełni funkcję repozytorium transakcji, zgodnie z Rozporządzeniem (UE) 648/2012 (EMIR), dzięki czemu posiada doświadczenie oraz szereg rozwiązań technologicznych i proceduralnych w zakresie przyjmowania i przechowywania raportów o transakcjach. Dodatkowo, dotychczasowa współpraca z krajowymi i zagranicznymi organami nadzoru, w szczególności z Komisją Nadzoru Finansowego pozwoliły na opracowanie przejrzystych i efektywnych rozwiązań w zakresie przetwarzania, udostępniania i dbałości o jakość zaraportowanych danych.

W ramach usługi ARM proponujemy Państwu trzy tryby raportowania. Z myślą o członkach Giełdy oraz uczestnikach Repozytorium Transakcji, opracowane zostały dwa uproszczone tryby raportowania transakcji, które umożliwią wywiązanie się z obowiązku raportowania transakcji zawieranych na rynku zorganizowanym (tryb uproszczony) oraz transakcji podlegających równolegle obowiązkowi raportowania zgodnie z rozporządzeniem EMIR, które są już raportowane do Repozytorium Transakcji prowadzonego przez KDPW (tryb RT). Usługę uzupełnia bezpośredni tryb raportowania adresowany do każdego podmiotu zobowiązanego do raportowania zgodnie z art. 26 MIFIR, niezależnie od rodzaju transakcji i miejsca ich zawarcia.

Na chwilę obecną, tryb uproszczony odnosi się wyłącznie do raportowania transakcji zawartych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie, tym niemniej prowadzone są konsultacje co do możliwości objęcia tym trybem raportowania również transakcji zawieranych na rynkach organizowanych przez BondSpot.

Specyfikacja usługi

Tryby raportowania oraz wymagania techniczne zostały opisane w przygotowanej dla Państwa dokumentacji, na którą składają się:

- materiał informacyjny dotyczący systemu do obsługi zatwierdzonego mechanizmu sprawozdawczego ARM;
- załączniki dotyczące projektowanej usługi.

Powyższe materiały zostaną opublikowane na stronie internetowej KDPW w sekcji ARM.

Jednocześnie, zwracamy Państwa uwagę na zawarty w materiale opis funkcjonalności, których ewentualne uruchomienie uzależnione będzie od zainteresowania rynku – zał. IX:

- uproszczone raportowanie transakcji zawieranych poza rynkiem zorganizowanym – rozrachowywanych w KDPW;
- powołanie dedykowanego komunikatu służącego do przekazania raportu rozkiegowującego transakcje zagregowane.

Harmonogram projektu

Biorąc pod uwagę fakt, że zgodnie z rozporządzeniem (EU) 2016/1033 z dnia 23 czerwca 2016 roku zmieniającym Rozporządzenie (EU) 600/2014, obowiązek zgłaszania transakcji wynikający z art. 26 MiFIR będzie mieć zastosowanie od dnia 3 stycznia 2018 roku, przedstawiamy ramowy harmonogram działań związanych z uruchomieniem usługi, pozwalający na jej wdrożenie w powyższym terminie:

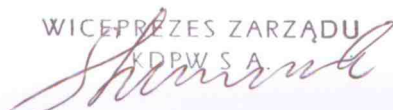
- opublikowanie materiałów informacyjnych oraz struktur nowych komunikatów – 8 maja 2017 r.,
- spotkanie z podmiotami zainteresowanymi usługą – 17 maja 2017 r.,
- aktualizacja struktur komunikatów KDPW_TR dostosowujących do RTS EMIR oraz umożliwiających jednocześnie składanie raportów do KDPW – maj 2017 r.,
- zamknięcie konsultacji z potencjalnymi klientami – 30 czerwca 2017 r.,
- spotkanie dotyczące testów usługi ARM – wrzesień 2017 r.,
- uruchomienie środowiska testowego dla potencjalnych klientów – październik 2017 r.,
- publikacja Regulaminu usługi ARM – grudzień 2017 r.,
- wdrożenie produkcyjne – grudzień 2017 r.

Równoległe z prowadzonymi pracami dotyczącymi technicznego aspektu uruchomienia usługi ARM będziemy prowadzić prace związane z uzyskaniem autoryzacji usługi przez Komisję Nadzoru Finansowego.

Spotkanie i konsultacje

Prosimy o zapoznanie się z załączonym materiałem oraz o przekazanie ewentualnych uwag do zaproponowanych rozwiązań podczas spotkania poświęconego usłudze ARM, które odbędzie się w dniu **17 maja 2017 r.** o godz. 10.00 w siedzibie KDPW przy ul. Książęcej 4. Wszelkie pytania związane z usługą, a także zgłoszenia na spotkanie prosimy przesyłać na adres: arm@kdpw.pl.

Z poważaniem,

WICEPREZES ZARZĄDU
KDPW S.A.

Sławomir Panasiuk