

DO /ZW/ 1976 /2021

Warszawa, 20 grudnia 2021 r.

Uczestnicy bezpośredni KDPW

dot.: projekt dostosowania KDPW do wymogów rozporządzenia CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku - testy

Szanowni Państwo,

W nawiązaniu do pisma DO/ZW/1631/2021 z dnia 21 października 2021 r. dotyczącego informacji o rozpoczęciu testów nowych funkcjonalności związanych z systemem kar pieniężnych i mechanizmami wspomaganie rozrachunku, przekazujemy poniżej aktualizację informacji, mającą na celu rozszerzeniu zakresu prowadzonych testów.

I. Testy systemu kar pieniężnych w środowisku TST B.

1. Kontynuacja testów wszystkich funkcjonalności udostępnionych w ramach etapu testów rozpoczętego 25.10.2021 r., tj.:
 - a. funkcjonalności związanych z naliczaniem kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek transakcji oraz przekazywaniem do uczestników raportów dziennych w postaci komunikatów semt.044.001.01
 - b. Komunikaty semt. 044.001.01 generowane dla zdarzeń zakwalifikowanych jako:
 - i. nowe kary pieniężne – dla zdarzeń z poprzedniego dnia rozrachunkowego,
 - ii. modyfikacje kar naliczonych wcześniej
2. Udostępniono funkcjonalności związane z tworzeniem i dystrybucją miesięcznych raportów w standardowym terminie 14-ego dnia PBD (Penalties Business Day)
3. W realizowanym etapie testów utrzymana zostanie zasada wyliczania kar pieniężnych przy założeniu korzystania z wyceny papierów wartościowych wg. zasad funkcjonujących obecnie w regulacjach KDPW i systemie depozytowym, a nie wg. docelowego rozwiązania, zgodnie z którym wycena ta będzie wspólna we wszystkich CSD, wyliczana wg. art.7 RTS 2017/389. Warto jednakże podkreślić, że nie wpływa to na możliwość merytorycznej oceny zakwalifikowania określonej operacji do naliczenia kary pieniężnej, jak również weryfikacji przetwarzania raportów udostępnianych przez KDPW.
4. W celu optymalizacji procesu naliczania kar pieniężnych zwracamy się do Państwa z prośbą o przekazywanie instrukcji rozrachunku z uwzględnieniem sald kont ewidencyjnych w środowisku testowym TST B. W szczególności zwracamy uwagę, że duża liczba niedokonanych terminowo rozrachunków, w tym zawieszonych rozrachunków

spowodowanych brakiem papierów wartościowych na kontach ewidencyjnych, może w tej fazie testów utrudniać identyfikację i weryfikację zaistniałych przypadków naliczenia kar pieniężnych.

II. Testy funkcjonalności wspomagających rozrachunek oraz zmiany w procesie przetwarzania instrukcji dot. rozrachunków posttransakcyjnych w środowisku TST B.

1. Kontynuacja testów wszystkich funkcjonalności udostępnionych w ramach etapu testów rozpoczętego 25.10.2021 r. – w szczególności w mechanizmie hold-release udostępnienie możliwości stosowania tej funkcjonalności w systemie sesyjnym oraz możliwość ustanawiania stanu „hold” w zakresie nierozrachowanej części instrukcji w relacji do instrukcji rozrachunku przekazywanych przez uczestników i podlegających procesowi zestawiania.
2. Udostępniono do testów dodatkowe funkcjonalności związane z:
 - a. ustanawianiem stanu hold/release w zakresie instrukcji nie podlegających zestawianiu i przekazywanych do systemu depozytowego przed podmioty nie będące stroną rozrachunku,
 - b. rekonfiguracją systemu pod względem stosowania kodu rynku XPXX, właściwego do obecnie stosowanego oznaczenia rozrachunków posttransakcyjnych – zmiana ma na celu dostosowanie do nowych zasad przetwarzania takich instrukcji, opisanych szczegółowo w piśmie DO/ZW/1505/2021 z dnia 29.09.2021 r.

III. Testy systemu kar pieniężnych w środowisku produkcyjnym (tzw. dry-run)

1. W ramach prowadzenia testów przedwdrożeniowych planowane jest uruchomienie części funkcjonalności dot. systemu kar pieniężnych w systemie produkcyjnym.
2. Wdrożone zmiany **będą neutralne** dla realizowanego procesu rozrachunku transakcji.
3. Proces rozrachunku transakcji oraz wszelkie funkcjonalności wspomagające rozrachunek będą wykonywane na obecnie obowiązujących zasadach.
4. Wdrażane w systemie produkcyjnym zmiany **obejmą** wyłącznie:
 - a. naliczanie kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek
 - b. wysyłkę raportów dziennych do uczestników KDPW
 - c. wysyłkę raportów miesięcznych do uczestników KDPW
5. Wdrażane zmiany nie wpłyną na faktycznie wykonywane czynności związane z procesami rozrachunkowymi, a tym samym **nie obejmą**:
 - a. procesu poboru i redystrybucji kar pieniężnych, w tym generowania instrukcji PFOD,
 - b. zmian związanych z systemem hold-release,
 - c. zmian w procesie przetwarzania instrukcji dot. rozrachunków posttransakcyjnych.
6. Planowane uruchomienie funkcjonalności w systemie produkcyjnym nastąpi w dniu 28 grudnia 2021 r., co oznacza, że za ten dzień powinny się wygenerować pierwsze raporty dzienne dot. kar pieniężnych, które zostaną przekazane do uczestników KDPW w kolejnym dniu (29.12.2021).

7. Raport miesięczny za grudzień 2021 r. obejmie 4 dni: 28-31 grudnia 2021 r., w zakresie których dokonano wyliczeń kar dziennych.
8. Testy w systemie produkcyjnym, podobnie jak testy w środowisku TST B, w momencie ich uruchomienia będą realizowane na bazie wyceny papierów wartościowych wg. zasad funkcjonujących obecnie w regulacjach KDPW i systemie depozytowym, a nie wg. docelowego rozwiązania, zgodnie z którym wycena ta będzie wspólna we wszystkich CSD, wyliczana wg. art.7 RTS 2017/389.

W przypadku potrzeby kontaktu operacyjnego związanego z prowadzeniem testów prosimy o przekazywanie informacji na adres mailowy: doro@kdpw.pl

Przypominamy również, że na portalu MyStandards, w domenie KDPW, jest dostępna struktura komunikatu semt.044.001.01, który będzie wykorzystywany przez KDPW do przekazywania dziennych i miesięcznych informacji o naliczonych karach pieniężnych wynikających z zasad dyscypliny rozrachunku CSDR. Zachęcamy do cyklicznej weryfikacji prezentowanej dokumentacji technicznej.

Informacje na temat toczących się prac związanych z tzw. dyscypliną rozrachunku, w tym dotychczasową korespondencją oraz notatki ze spotkań roboczych, znajdują Państwo na stronie internetowej KDPW, w zakładce Usługi/Rozwój/Dostosowanie do wymogów CSDR. Link do niniejszej dokumentacji:

<http://www.kdpw.pl/pl/uslugi/Rozwoj/CSDR/Strony/default.aspx>

Z poważaniem,

Krzysztof Ołdak
Dyrektor Działu Operacyjnego