

Notatka ze spotkania

projekt: Wprowadzenie zmian w zakresie dyscypliny rozrachunku w związku z procesem autoryzacji
KDPW

Data spotkania: 06.02.2020

Uczestnicy:

1. Reprezentacja RBD
2. Reprezentacja IDM
3. Reprezentacja KDPW_CCP
4. Reprezentacja KDPW

Omawiane kwestie:**I Zagadnienie wstępne**

1. Powitanie
2. Informacja o Final Report ESMA dot. przesunięcia terminu wdrożenia zmian związanych z dyscypliną rozrachunku na 1.02.2021; zmiana wymaga akceptacji Komisji Europejskiej
3. Następne spotkanie
 - 1) 25.02.2020
 - 2) tematy dot. dyscypliny rozrachunku
 - 3) temat przelewów posttransakcyjnych - finalizacja

II Obsługa rozrachunków posttransakcyjnych po wdrożeniu zmian związanych z dyscypliną rozrachunku

1. Przypomnienie ustaleń z 2016
2. Ustalenia:
 - 1) ustanowienie opcjonalnego „parametru” w oznaczeniu operacji, wskazującego na rozrachunek posttransakcyjny,
 - 2) „parametr” – pozostawienia odrębnego oznaczenia kodu rynku – jak obecnie KDPW/XPXX
 - 3) opcjonalność wskazania w instrukcji ww. kodu rynku
 - 4) zasady zestawiania:
 - a) zgodne wskazanie z obu stron – zestawienia
 - b) różne wskazanie kodu rynku z obu stron – brak zestawienia
 - c) wskazanie przez jedną stronę i brak wskazania z drugiej strony – zestawienie
 - 5) KDPW ustali co przenosi się do wynikowego dowodu ewidencyjnego, nie ma to znaczenia dla uczestników ponieważ strony otrzymują informacje z referencją do własnej instrukcji,
 - 6) zmiany w SZD KDPW:
 - a) w zał.2 zostaje oznaczenie KDPW/XPXX
 - b) wprowadzenie ww. opisanych zasad zestawiania
 - 7) dyskusja nt. obsługi takich operacji w nietypowe dni księgowe, w których nie dokonuje się rozrachunku transakcji rynku zorganizowanego (Wigilia, Sylwester, Wielki Piątek):
 - a) stanowisko DM – nie dopuszczać do rozrachunku w takie dni,
 - b) KDPW wskazał, że kontrahent (który nie wskazał oznaczenia przelewu posttransakcyjnego) nie będzie znał przyczyny braku rozrachunku w takie dni,

- c) propozycja zamknięcia systemu rozrachunku w takie dni, za wyjątkiem operacji dot. zabezpieczeń kredytu w NBP (czyli np. 3 maja) – w ocenie KDPW mało realny scenariusz, bowiem 31 grudnia jest istotny dla możliwości dokonywania transakcji OTC,
- d) KDPW przeanalizuje czy można nie kierować do rozrachunku w takie dni operacji wskazujących na przelew posttransakcyjny,
- e) dokończenie dyskusji na następnym spotkaniu.

III Wskaźnik RwC w komunikacie statusowym (sese.sts.001.05)

1. Zgłoszono brak wskaźnika zgody/braku zgodny na RwC w komunikacie dot. statusu instrukcji
2. KDPW może wykonać prace w celu umieszczenie tej informacji w dedykowanym polu
3. Wdrożenie możliwe razem ze zmianami w kontroli pokrycia i zmianach dot. RwC
4. Przy okazji dyskusja nt. terminu wprowadzenia zmian w kontroli pokrycia i zmianach dot. RwC – propozycja, aby wdrożenie było w oknie 3 września 2020, razem z SRD2
5. W takim scenariuszu testy zewnętrzne w okresie maj-czerwiec.

IV Zmiany w miesięcznych sprawozdaniach sporządzanych przez podmioty obowiązane zaproponowane przez MF w rozporządzeniu dot. sprawozdawczości z obligacji Skarbu Państwa

1. Krótka prezentacja zmian – konieczność dostosowań w systemach informatycznych
2. W ocenie uczestników spotkania zmiany powinny być wprowadzone później niż zaproponowano – optymalny termin to 1 października 2020 (raportowanie za wrzesień 2020).

V Limit tolerancji

1. Nawiązanie do dyskusji ze spotkania 28.01.2020
2. Uczestnicy zaproponowali rozwiązanie, aby system KDPW „ignorował” wypełnienie pola dedykowanego obecnie do zgody/brak zgody na limit tolerancji. Nieistotne co zostało wskazane, uznawać za brak wypełnienia.

VI Zmiany w raportowaniu błędów rozmnożenia emisji w raportach dziennych dla celów nadzorczych

1. Rozszerzenie przekazywanej informacji o wszystkie nieprawidłowości powodujące zwiększenie stanów na rachunkach uczestnika w odniesieniu do stanu na koncie depozytowym, w tym również w wyniku transakcji/operacji spoza rynku zorganizowanego,
2. Bez zmiany struktury komunikatu, w ramach istniejącej dotychczasowej informacji o tego rodzaju błędach,
3. Jednoczesne odstąpienie od przesyłania comiesięcznych zestawień informujących o błędnie zawartych transakcjach,
4. Wdrożenie wraz z dyscypliną rozrachunku.