

Notatka ze spotkania

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

Data spotkania: 26.03.2021

Uczestnicy:

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

Omawiane kwestie:**I Sprawy formalne – etapy wdrożeniowe**

1. Zmiany w RTS'ach dot. dyscypliny rozrachunku:
 - 1) pierwsza zmiana z września 2020 na 1.02.2021
 - 2) druga zmiana z 1.202.2021 na 1.02.2022 (COVID)
2. Zmiany w zakresie terminu wejścia w życie RTS spowodowały rewizję harmonogramów w KDPW, w tym:
 - 1) I etap na 19.04.2021
 - 2) II etap na 1.02.2022
 - 3) szczegóły w piśmie z 29.09.2020
3. Obecnie od 18.12.2020 jest udostępnione środowisko do testów wdrożeń I etapu
4. Pod kątem II etapu istotnym dokumentem pomocniczym jest ECSDA Framework – w grudniu 2020 była kolejna aktualizacja - [link](#).

II Wdrożenia I etapu - przypomnienie

1. Limit tolerancji
 - 1) szczegóły w piśmie z 18.12.2020
 - 2) kwestia przeliczania EUR na PLN
 - a) stosujemy kurs wymiany obowiązujący na 1 stycznia danego roku – na 2021 jest 4,5597 PLN/EUR
 - b) nie oznacza, że progi dla PLN są wprost wyznaczone w PLN,
 - c) algorytm w systemie jest następujący:
 - analizujemy instrukcję sprzedającego (instrukcja sprzedającego ma kluczowe znaczenia, bo ta instrukcja przesądza o wartości limitu) i wyliczamy jej wartość w EUR – np. 150zł: 4,5597= 32,87 EUR
 - określamy dla tej instrukcji limit tolerancji - w przykładzie 2 EUR, bo jest w progu do 100.000 EUR
 - badamy instrukcje kupującego i wyliczamy jej wartość w EUR – np. 142 zł : 4,5597= 31,14 EUR
 - różnica między wartościami = 32,87 – 31,14 = 1,73 EUR, czyli mieści się w 2 EUR, zatem zestawienie
 - 3) zgodność zleceń (zestawianie) jest realizowane w danym dniu z uwzględnieniem obowiązujących w tym dniu limitów tolerancji – ważne na przełomie roku, w szczególnym jeśli instrukcje nie

zestawią się 31 grudnia i przejdą jako niezestawione na 2 stycznia i jeśli 2 stycznia będą inne limity, w szczególności wyższe, to te instrukcje mogą się zestawić.

2. Odwoływanie zleceń rozrachunku – wprowadzenie dodatkowo możliwość odwołania przez uczestników instrukcji dostarczonej przez podmiot trzeci; nie dotyczy transakcji zabezpieczonych funduszem rozliczeniowym
3. Rozrachunek w częściach
 - 1) spore zmiany wdrożone w listopadzie 2020
 - 2) rozszerzenie zakresu stosowania RWC – zmiany do SZD, załącznik nr 2
 - 3) nie obejmuje wszystkich operacji – wyłączenia:
 - a) operacje związane z transferami międzysystemowymi
 - b) przetargi obligacji
 - c) operacje wymagające realizacji kilku księgowiń, w tym: tri-party repo, pożyczki papierów wartościowych, tzw. zabezpieczenia bilateralne,
 - d) operacje dot. rejestracji papierów w depozycie, wyrejestrowań i operacji na papierach wartościowych
 - e) instrukcje zmiany statusu aktywów
 - 4) zniesione progi wartościowe
 - 5) wprowadzenie RWC w RTGS, tylko dla braku papierów wartościowych
4. Wskazywanie miejsca rozliczenia w instrukcji – pole wprowadzone w 2017 r.
5. Zmiany w Regulaminie – dostępne; uchwała RN KDPW 76/893/20, ale jeszcze w zakresie niniejszych zmian nie weszła w życie
6. Zmiany w SZD KDPW – w toku konsultacji

III Plany w zakresie testów II etapu – ogólne omówienie zagadnienia

1. Zgodnie z pismem z 30.09.2020 (dot. planów wdrożeniowych) testy II etapu rozpoczną się na przełomie września/października 2021
2. Niektóre CSD planują testy na danych produkcyjnych, bez poboru i redystrybucji kar – KDPW rozważy takie możliwości

IV Struktury komunikatów ISO20022 dla raportowania transakcji buy-in

1. Omówienie zagadnienia

V Sprawy różne

1. Pytanie czy CCP planuje przekazanie obsługi kar pieniężnych do CSD – odp. takie są nasze plany
2. Informacja – na forum europejskim toczy się dyskusja nt. obligatoryjności transakcji buy-in – ankiety wskazują, że zdecydowana większość uczestników rynku jest przeciwko.
3. Ważne tematy na kolejne spotkania
 - 1) Często są przedmiotem dyskusji kwestie brak płatności kar pieniężnych
 - 2) W przypadku identyfikacji zagadnień do omówienia prosba o przesłanie informacji w ramach grupy
4. Następane spotkanie – najlepiej w tygodniu 12-16/04 a najpóźniej 19-23/04