

DO /ZW/ 153 /2018

Warszawa, 30 stycznia 2018 r.

Uczestnicy KDPW

Szanowni Państwo,

W nawiązaniu do pisma sygn. SCP/ZW/19/2017 z dnia 29 września 2017 r., dotyczącego zmian w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP zaplanowanych na 2018 r., przekazujemy w załączeniu informacje uzupełniające, związane z wprowadzeniem wymogu wysyłania przez KDPW wyciągu zbiorczego na koniec każdego dnia ewidencyjnego w związku z dostosowaniem do wymogów CSDR. Jednocześnie pragniemy poinformować, że wdrożenie ww. wymogu jest zgodne z międzynarodowymi zasadami i będzie obejmować, oprócz komunikatu xml „wyciąg z konta rozrachunkowego” (semt.smt.001.04) również wyciąg przekazywany w formie komunikatu zgodnego z normą ISO2022 (semt.017.001.07) oraz normą ISO15022 (MT536).

Przypominamy również, że niezależnie od otrzymywanego wyciągu mają Państwo do dyspozycji możliwość otrzymywania informacji o stanie posiadanych papierów wartościowych poprzez subskrypcję komunikatu xml „zestawienie stanów posiadania” (semt.smh.001.02).

Wdrożenie ww. zmian zostało zaplanowane w ramach wiosennego okna wdrożeniowego w dniach 21 – 22 kwietnia 2018r. Zgodnie z planem rozpoczęcie testów nastąpi 19 marca 2018 r.

Z poważaniem,

Dyrektor Działu Operacyjnego
Krzysztof Ołdak

Zmiany w zakresie obsługi wyciągu zbiorczego na koniec dnia ewidencyjnego

Data aktualizacji	wersja	Opis
Styczeń 2018	1.0	Utworzenie dokumentu

1. Wstęp

Niniejszy dokument zawiera założenia, dotyczące obsługi wyciągów zbiorczych na koniec dnia ewidencyjnego w związku z dostosowaniem do wymogów CSDR. Potrzeba zmian wynika z art. 64 ust. 4 standardów technicznych do rozporządzenia CSDR (rozporządzenie delegowane Komisji UE 2017/391 z dnia 11 listopada 2016 uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady UE nr 909/2014, dotyczącego przekazywania uczestnikom bezpośrednim centralnych depozytów wyciągów wykorzystywanych na potrzeby procesów uzgodnieniowych.

2. Stan obecny

Zgodnie z obecnie obowiązującymi zasadami wyciąg zbiorczy na koniec dnia jest udostępniany uczestnikom KDPW w dniach, w których są zaewidencjonowane jakiegokolwiek operacje na koncie ewidencyjnym prowadzonym dla uczestnika w formie komunikatu xml (semt.smt.001.04) lub w formie komunikatu zgodnego z normą ISO20022 (semt.017.001.07) lub ISO15022 (MT536).

3. Planowane zmiany

1. Wyciąg zbiorczy na koniec dnia ewidencyjnego będzie udostępniany uczestnikowi, niezależnie od tego, czy na danym koncie ewidencyjnym były tego dnia ewidencjonowane operacje, czy też nie wystąpiły żadne księgowania,
2. Wprowadzenie zmian w zakresie przekazywania zbiorczego wyciągu na koniec dnia nie będzie skutkowało zmianami w strukturze komunikatu xml „wyciąg z konta rozrachunkowego” (semt.smt.001.04),
3. Nastąpi rozpoczęcie stosowania w praktyce przewidzianego w polu 2.3 (Actvtylnd) znacznika aktywności, służącego do oznaczenia, czy w danym dniu na danym koncie ewidencyjnym nastąpiło księgowanie, czy też nie. Wartość „Y” oznacza, że istnieją operacje, dotyczące określonego konta wskazanego na wyciągu, natomiast wartość „N” oznacza brak aktywności na danym koncie wskazanym na wyciągu,
4. Wskazanie wartości „N” w polu, o którym mowa w pkt 3 oznacza, że nie zmienił się stan papierów wartościowych na koncie w stosunku do poprzednio wskazanego stanu. W praktyce oznacza to, że wskaźnik ten będzie stosowany w następujących przypadkach:
 - a. dla kont, na których były rejestrowane papiery wartościowe,
 - b. dla kont, na których nie były zarejestrowane żadne papiery wartościowe.

5. Skutkiem powyższych zmian będzie rozbudowa wyciągu przekazywanego w formie komunikatu xml (semt.smt.001.04) o powtarzalne sekcje, dotyczące kont dla których nie było zaewidencjonowanych operacji, ale zostały ujęte w wyciągu.
6. W przypadku wyciągu przekazywanego w formie komunikatu zgodnego z normą ISO20022 (semt.017.001.07) lub zgodnego z normą ISO15022 (MT536) nastąpi zwiększenie liczby przekazywanych plików (jeden komunikat dla jednego konta).

4. Przykłady komunikatów

Poniżej przedstawiono przykład komunikatu „wyciąg z konta rozrachunkowego” w formacie xml (semt.smt.001.04), w formacie ISO15022 oraz w formacie ISO20022:

- a) xml kdpw_stream – semt.smt.001.04:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<KDPWDocument xmlns="urn:kdpw:xsd:semt.smt.001.04"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  Sndr="0001" Rcvr="XYZZ">
  <semt.smt.001.04 >
    <GnlInf>
      <SndrMsgRef>ABCD</SndrMsgRef>
      <FuncOfMsg>NEWM</FuncOfMsg>
      <FrDt>2018-05-14</FrDt>
      <ToDt>2018-05-14</ToDt>
    </GnlInf>
    <StmtForAcct>
      <KDPWSafAcct>ACC1</KDPWSafAcct>
      <ActvtyInd>N</ActvtyInd>
    </StmtForAcct>
  </semt.smt.001.04>
</KDPWDocument>
```

- b) ISO150022 – MT536:

```
:16R:GENL
:28E:1/ONLY
:20C::SEME//ABCD
:23G:NEWM
:98C::PREP//20180514171030
:69A::STAT//20180514
:22F::SFRE//DAIL
:22F::CODE//COMP
:22F::STBA//SETT
:95R::ACOW/KDPW/XYZZ
:97A::SAFE//ACC1
::17B::ACTI//N
:17B::CONS//Y
:16S:GENL
```

c) ISO200022 – semt.017.001.07:

```

<SciesTxPstngRpt>
  <Pgntn>
    <PgNb>1</PgNb>
    <LastPgInd>true</LastPgInd>
  </Pgntn>
  <StmntGnlDtls>
    <StmntPrd>
      <FrDtToDt>
        <FrDt>2018-05-14</FrDt>
        <ToDt>2018-05-14</ToDt>
      </FrDtToDt>
    </StmntPrd>
    <Frqcy>
      <Cd>DAIL</Cd>
    </Frqcy>
    <UpdTp>
      <Cd>COMP</Cd>
    </UpdTp>
    <StmntBsis>
      <Cd>SETT</Cd>
    </StmntBsis>
    <ActvtyInd>false</ActvtyInd>
    <SubAcctInd>true</SubAcctInd>
  </StmntGnlDtls>
  <AcctOwnc>
    <PrtryId>
      <Id>XYZZ</Id>
      <Issr>KDPW</Issr>
    </PrtryId>
  </AcctOwnc>
  <SfkpgAcct>
    <Id>ACC1</Id>
  </SfkpgAcct>
</SciesTxPstngRpt>

```