

DO /ZW/ 1631 /2021

Warszawa, 21 października 2021 r.

Uczestnicy bezpośredni KDPW

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

Szanowni Państwo,

W nawiązaniu do pisma DO/ZW/1505/2021 z dnia 29 września 2021 r. zawierającego aktualizację dokumentu dotyczącego systemu kar pieniężnych i opis zmian w mechanizmach wspomaganie rozrachunku, jak również pisma SCP/ZW/8/2021 dot. zmian w systemach informatycznych wdrażanych w 2022 r., uprzejmie informujemy, że na dzień 25 października 2021 r. planowane jest rozpoczęcie testów z udziałem zewnętrznych podmiotów (uczestników KDPW).

Poniżej przekazujemy Państwu informacje o zakresie i warunkach prowadzenia ww. testów.

1. W ramach rozpoczynanego etapu (tzw. etap 1) możliwe będzie testowanie:
  - a. systemu kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek - udostępnienie funkcjonalności związanych z naliczaniem kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek transakcji oraz przekazywaniem do uczestników raportów dziennych w postaci komunikatów semt.044.001.01,
  - b. mechanizmu 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. Komunikaty semt. 044.001.01 będą generowane dla zdarzeń zakwalifikowanych jako:
  - a. nowe kary pieniężne – dla zdarzeń z poprzedniego dnia rozrachunkowego,
  - b. modyfikacje kar naliczonych wcześniej.
3. W zakresie tego etapu testów nie jest planowane testowanie generacji komunikatów dot. raportów miesięcznych w standardowym terminie 14-ego dnia PBD (Penalties Business Day) - tym samym w zakresie kar naliczonych za październik 2021 raporty miesięczne mogą być wygenerowane w terminie późniejszym niż 14-ego dnia PBD (nie później niż do końca listopada).
4. Raporty dzienne, na obecnym etapie testów, będą tworzone przy założeniu korzystania z wyceny papierów wartościowych wg. zasad funkcjonujących obecnie w regulacjach KDPW i system depozytowy, 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.

5. Testy będą przeprowadzane w środowisku TST\_B systemu kdpw\_stream.
6. Zasady korzystania ze środowiska testowego systemu kdpw\_stream są zamieszczone na stronie KDPW - [link](#)
7. 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.

W ramach kolejnych faz testów będą udostępniane dalsze funkcjonalności, w szczególności:

- pełne funkcjonalności związane z raportowaniem miesięcznym w zakresie kar pieniężnych,
- zmiany dot. poboru i redystrybucji kar pieniężnych,
- pozostałe funkcjonalności w mechanizmach wspomagających rozrachunek – przede wszystkim w zakresie hold-release dotyczącym instrukcji nie podlegających zestawianiu i przekazywanych do systemu depozytowego przed podmioty nie będące stroną rozrachunku,
- zmiany w procesie przetwarzania instrukcji dot. rozrachunków posttransakcyjnych.

O rozpoczęciu kolejnych faz testów będziemy Państwa informować odrębnymi pismami.

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

Informacje na temat toczących się prac związanych z tzw. dyscypliną rozrachunku, w tym dotychczasową korespondencją oraz notatki ze spotkań roboczych, znajdą 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