

Warszawa, 8 maja 2019 r.

Uczestnicy KDPW
Uczestnicy KDPW_CCP

dot.: zmian wynikających z projektu dostosowania do wymogów CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku

Szanowni Państwo,

W nawiązaniu do pisma z dnia 28 września 2018 r. (sygn. SCP/ZW/26/2018 i CCP/ZW/675/2018) w załączeniu przekazujemy materiały, dotyczące drugiego etapu prac projektowych związanych z autoryzacją KDPW zgodnie z rozporządzeniem CSDR w zakresie dostosowania do wymogów wynikających z dyscypliny rozrachunku. W szczególności są one związane z opublikowanym w Dzienniku Urzędowym Unii Europejskiej w dniu 13 września 2018 r. rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2018/1229 z dnia 25 maja 2018 r. uzupełniającym rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 909/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w zakresie dyscypliny rozrachunku. Implementacja zmian wynikających z ww. przepisów nastąpi do dnia 13 września 2020 r.

I. System depozytowy KDPW

Zmiany obejmą następujące obszary funkcjonalne:

1. Procesy wspomagające rozrachunek:
 - Zmiany w obsłudze „tolerance level”,
 - Zmiany w obsłudze mechanizmu „hold-release”,
 - Zmiany w obsłudze odwoływania zleceń rozrachunku,
 - Zmiany w obsłudze rozrachunku w częściach,
 - Zmiany w obsłudze pola „place of clearing”,

2. Mechanizmy związane z obsługą transakcji „buy-in”,
3. System kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek transakcji, w tym redystrybucja pobranych kar, nowe zasady monitorowania nieterminowego rozrachunku i raportowania w tym zakresie.

Pragniemy podkreślić, że przekazany materiał obejmuje szczegółowy opis planowanych zmian, natomiast nie zawiera informacji szczegółowych w zakresie struktur komunikatów systemowych, które będą związane z systemem kar pieniężnych naliczanych za nieterminowy rozrachunek. Jak wskazaliśmy w ww. piśmie intencją KDPW jest wykorzystanie komunikatów opartych na standardowych rozwiązaniach opracowanych w ramach grup roboczych (w szczególności SMPG) i zgodnych z normami ISO. Z uwagi na systematyczne poszerzanie gamy komunikatów opartych o normę ISO2022 w zakresie komunikacji uczestników z systemem kdpw_stream chcemy, aby również w zakresie niniejszego projektu zostały wdrożone komunikaty zgodne z tą normą. Jednakże do chwili obecnej nie zakończono prac w ramach grup roboczych na poziomie europejskim, mających na celu uzgodnienie ostatecznej wersji ww. komunikatów, dlatego informacja o szczegółach struktur raportów, dotyczących kar pieniężnych zostanie Państwu przekazana niezwłocznie po wypracowaniu rozwiązań w tym zakresie. Materiały informacyjne, dotyczące niniejszego projektu będą zamieszczane na stronie internetowej KDPW, w zakładce: Usługi/Dostosowanie do wymogów CSDR ([link: http://www.kdpw.pl/pl/uslugi/Rozwoj/CSDR/Strony/default.aspx](http://www.kdpw.pl/pl/uslugi/Rozwoj/CSDR/Strony/default.aspx))

II. System rozliczeniowy KDPW_CCP

Główne aspekty poruszone w rozporządzeniu, dotyczące transakcji rozliczanych przez KDPW_CCP to:

1. obliczanie i stosowanie kar pieniężnych w stosunku do uczestników rozliczających powodujących zawieszenie rozrachunku na podstawie danych z KDPW,
2. dystrybucja kar pieniężnych do uczestników rozliczających, którzy są stroną rozliczenia oczekującą na papiery wartościowe na podstawie danych z KDPW,
3. odkup papierów wartościowych na zlecenie KDPW_CCP,
4. zwrot kosztów związanych z odkupem papierów wartościowych,
5. rekompensata pieniężna wypłacana uczestnikowi nabywającemu papiery wartościowe w przypadku braku możliwości dokonania zakupu papierów wartościowych.
6. powiadamianie uczestników rozliczających o realizacji procedur związanych z dyscypliną rozrachunku i ich wynikach,
7. raportowanie stosownych informacji do KDPW.

KDPW_CCP planuje wprowadzenie nowego komunikatu XML informującego o realizacji procedur związanych z dyscypliną rozrachunku, w szczególności o wysokości naliczonej kary pieniężnej wynikającej z zawieszonoego rozrachunku papierów wartościowych. Komunikat ten będzie udostępniany uczestnikom powodującym zawieszenie rozrachunku oraz uczestnikom poszkodowanym z tego powodu. Pozostałe informacje dotyczące nieterminowego rozrachunku, odrzucenia instrukcji

rozrachunku lub odkupu papierów wartościowych będą przekazywane w obecnie funkcjonujących komunikatach wymienianych z uczestnikami rozliczającymi.

Ze względu na trwający w ramach grup roboczych na poziomie europejskich instytucji proces standaryzacji realizacji wymogów regulacyjnych, szczegóły nowego komunikatu prześlemy Państwu w możliwie najkrótszym terminie.

Materiały informacyjne, dotyczące projektu prowadzonego w ramach KDPW_CCP będą zamieszczane na stronie www.kdpwccp.pl, w zakładce:

http://www.kdpwccp.pl/pl/Uslugi/dyscyplina_rozrachunku/Strony/default.aspx.

Z poważaniem,

Wiceprezes Zarządu KDPW S.A.

Sławomir Panasiuk

Załączniki:

1. Założenia, dotyczące dostosowania KDPW do Rozporządzenia CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku,
2. Założenia, dotyczące dostosowania KDPW_CCP do Rozporządzenia CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku.