

SCP/ZW/2/2022
CCP/ZW/65/2022

Warszawa, 20 stycznia 2022 r.

Uczestnicy KDPW
Uczestnicy KDPW_CCP

dot.: wdrożeń w dniu 1 lutego 2022 r. w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP w związku z dostosowaniem do wymogów rozporządzenia CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku

Szanowni Państwo,

nawiązując do naszego pisma (SCP/ZW/8/2021 - CCP/ZW/622/2021) z dnia 30 września 2021 r. zawierającego informacje o planach na 2022 r. związanych ze zmianami w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP, wynikających ze zmian w zakresie świadczonych usług lub zmian regulacyjnych, uprzejmie informujemy, że w dniu **1 lutego 2022 r.** w ramach zimowego okna wdrożeniowego 2022, wprowadzone zostaną zmiany związane z **dostosowaniem GK KDPW do wymogów rozporządzenia CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku (II etap projektu).**

W tym dniu, w systemach informatycznych GK KDPW wprowadzone zostaną wymienione poniżej funkcjonalności:

- nowy system naliczania kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek, w tym mechanizmy redystrybucji naliczonych kwot do kontrahentów przez KDPW i KDPW_CCP,
- mechanizmy monitoringu uczestników w zakresie terminowości rozrachunku i oceny efektywności rozrachunku oraz mechanizmy raportowania do nadzorca w zakresie dyscypliny rozrachunku,
- zmiany w funkcjonującym już obecnie mechanizmie hold-release.

Dodatkowo zostaną zaimplementowane zmiany w procesie przetwarzania zleceń rozrachunku dotyczących rozrachunków posttransakcyjnych – zmiany są efektem dyskusji przeprowadzonych w ramach grup roboczych, mających na celu usprawnienie przetwarzania instrukcji przekazywanych przez klientów uczestników, a w szczególności pozwalających na brak oznaczania instrukcji specyficznym kodem związanym z rozrachunkiem posttransakcyjnym (w systemie KDPW kod rynku XPXX).

Informujemy ponadto, że z uwagi na wydany przez ESMA komunikat dotyczący procesów związanych z transakcjami buy-in ([link](#)), w systemie Krajowego Depozytu nie będą wdrażane w ramach niniejszego okna wdrożeniowego mechanizmy związane z raportowaniem do KDPW informacji o tego rodzaju transakcjach. Natomiast w ramach mechanizmów wspierających procesy rozrachunku związane z potencjalnym stosowaniem przez uczestników operacji odkupu papierów na otwartym rynku (buy-in) KDPW oferować będzie pełen zakres funkcjonalności, w szczególności:

- 1) mechanizm hold-release, z uwzględnieniem zmian wdrażanych w dniu 1 lutego 2022 r.,
- 2) mechanizm odwoływania instrukcji rozrachunku,
- 3) rozrachunek w częściach, w tym wykorzystanie mechanizmu zmiany zgody na rozrachunek w częściach w instrukcji rozrachunku, realizowany przy użyciu instrukcji technicznych,
- 4) wprowadzenie nowego oznaczenia kodowego operacji dla transakcji buy-in zawieranej poza system obrotu.

W systemie KDPW_CCP w związku z trwającymi procesami autoryzacyjnymi z dniem 1 lutego 2022 r. zaimplementowane zostaną wyłącznie zmiany dotyczące pobierania i redystrybucji kar pieniężnych przez KDPW_CCP na podstawie danych z KDPW wraz z zastosowaniem nowych, dedykowanych do tych operacji kodów w systemach płatniczych.

Testy

Jednocześnie nawiązując do pism: DO/ZW/1631/2021 z dnia 21 października 2021 r. oraz CCP/ZW/804/2021 z dnia 17 grudnia 2021 r. uprzejmie informujemy, że nowe rozwiązania udostępnione zostały do testów w środowisku testowym TST B odpowiednio w dniach 25 października 2021 r. oraz 20 grudnia 2021 r.

Ponadto, w ślad za informacją zawartą w piśmie DO/ZW/1976/2021 z dnia 20 grudnia 2021 r., w ramach testów przedwdrożeńowych w dniu 28 grudnia 2021 r. część funkcjonalności dot. systemu kar pieniężnych uruchomiona została w środowisku produkcyjnym (tzw. dry-run).

Regulacje KDPW

1. uchwała Rady Nadzorczej KDPW S.A. nr 51/938/21 z dnia 8 listopada 2021 r. opublikowana w dniu 18 stycznia 2022 r. ([link](#)),
2. uchwała Rady Nadzorczej KDPW S.A. nr 48/935/21 z dnia 8 października 2021 r. opublikowana w dniu 16 grudnia 2021 r. – w zakresie zmian w Tabeli opłat KDPW określonych w § 1 pkt 1 lit. f/-m/ tej uchwały ([link](#)),

3. uchwała Zarządu KDPW S.A. nr 60/2022 z dnia 18 stycznia 2022 r. w sprawie zmian Szczegółowych Zasad Działania KDPW oraz Procedur Ewidencyjnych KDPW ([link](#)),
4. uchwała Zarządu KDPW S.A. nr 61/2022 z dnia 18 stycznia 2022 r. w sprawie zmiany uchwały dotyczącej realizowania płatności wynikających z rozrachunków transakcji i innych operacji dokonywanych przez Krajowy Depozyt oraz w sprawie banków rozliczeniowych ([link](#)).

Wszystkie materiały, pełna korespondencja, w tym notatki ze spotkań Grupy roboczej ds. dyscypliny rozrachunku dostępne są na:

- stronie internetowej KDPW ([link](#)),
- stronie internetowej KDPW_CCP ([link](#)),

Ponadto struktury komunikatów ISO 20022 z kolekcji wykorzystywanej przez KDPW i KDPW_CCP umieszczone są na platformie [MyStandards](#).

Z poważaniem,
Sławomir Panasiuk
Wiceprezes Zarządu

Do wiadomości:

Narodowy Bank Polski
Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.
BondSpot S.A.
Izba Domów Maklerskich
Rada Banków Depozytariuszy przy ZBP
Komisja Nadzoru Finansowego