
Oznaczanie typów operacji rozrachunkowych zgodnie ze standardami ISO 15022/20022 w systemie kdpw_stream

Specyfikacja wymagań biznesowych

Wersja 0.4

Warszawa, czerwiec 2016 r.

Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.
ul. Książęca 4
00-498 Warszawa
T 22 537 93 43
F 22 627 31 11
E kdpw@kdpw.pl
www.kdpw.pl

Spis treści

Historia zmian	3
1. Wstęp	3
2. Atrybuty opisujące typy operacji rozrachunku.....	4
3. Sposób oznaczania typów operacji dla wybranych procesów rozrachunkowych.....	7
3.1 Transakcja OTC.....	7
3.2 Transakcje wymagające wyróżnienia fazy otwarcia i zamknięcia.....	7
3.3 Zdarzenia korporacyjne i operacje na papierach.....	10
4. Lista operacji rozrachunkowych systemu kdpw_stream	11
5. Okres przejściowy.....	27
Załącznik 1 – Lista typów operacji w komunikatach ISO20022	28
Załącznik 2 – Kody operacji w standardach technicznych ESMA dotyczących CSDR.....	29
Załącznik 3 – Definicja kodu rynku w komunikatach ISO150022/20022.....	29

Historia zmian

20.06.2016	KDPW
wersja 0.4	Uwzględnienie uzgodnień z NMPG, aktualizacja podziału na instrukcje zestawiane i nie wymagające zestawiania
06.05.2016	KDPW
wersja 0.3.4	Oznaczenie otwartych zagadnień w trakcie dyskusji NMPG
26.04.2016	NMPG
wersja 0.3.3	Uwagi uzgodnione podczas spotkania S&R NMPG PL
15.04.2016	KDPW
wersja 0.3.2	Doprecyzowanie zapisów dot. CA/ operacji na papierach
31.03.2016	KDPW
wersja 0.3.1	Uwagi po spotkaniu NMPG PL
11.03.2016	KDPW
wersja 0.2	Reorganizacja tabeli operacji
19.11.2015	KDPW
wersja 0.1	Utworzenie dokumentu

1. Wstęp

Dokument opisuje sposób oznaczania typów operacji rozrachunkowych zgodnie z wymogami standardów ISO15022/20022 w systemie kdpw_stream.

Wprowadzenie standardowych atrybutów operacji rozrachunkowych jest jednym z istotnych elementów dostosowywania zasad komunikacji systemów KDPW do norm i praktyk międzynarodowych.

Wymóg rejestrowania operacji z podziałem na typy operacji zgodne ze standardami ISO wynika ze standardów technicznych ESMA (European Securities and Markets Authority) towarzyszących europejskiej regulacji CSDR (Regulation on improving securities settlement in the European Union and on central securities depositories).

W dokumencie przedstawiono porównanie dotychczasowych i nowych atrybutów opisujących typy operacji rozrachunkowych w komunikatach systemu kdpw_stream.

Materiał zawiera pełną listę typów operacji rozrachunkowych obsługiwanych w KDPW wraz z nowymi oznaczeniami kodowymi.

2. Atrybuty opisujące typy operacji rozrachunku

Operacje rozrachunkowe są obecnie opisywane w systemie kdpw_stream następującym zestawem atrybutów:

- Typ operacji rozrachunku KDPW - (*KDPWSttlmTxTp*) - 2 znaki
- Kod rynku KDPW (*KDPWPlcOfTrad*) - 2 znaki
- Tryb obrotu KDPW (*KDPWTradMode*) - 2 znaki
- Faza operacji (*TxPhs*) - 4 znaki

Wszystkie wymienione powyżej atrybuty mogą przyjmować wartości określone przez KDPW i opisane w *Szczegółowych Zasadach Działania KDPW*.

W nowym rozwiązaniu do wyznaczania charakterystyki operacji rozrachunku zostaną wykorzystane następujące atrybuty:

- **Typ operacji rozrachunku** (*SttlmTxTp*) - 4 znaki
Obowiązkowy atrybut instrukcji rozrachunku.
Stosowane będą czteroznakowe kody zgodne ze słownikiem ISO15022 dla pola: *22F::SETR - Type of Settlement Transaction* (odpowiednio *SctiesTxTp - SecuritiesTransactionType* w ISO20022).
- **Kod rynku** (*PlcOfTrad*) – max 16 znaków
Pole opcjonalne.
Wykorzystywane w przypadku konieczności określenia miejsca dokonania pierwotnej transakcji, której dotyczy instrukcja rozrachunku.
Dla oznaczania rynków giełdowych stosowany będzie kod MIC.
Odpowiednik pola *94B::TRAD – Place of Trade* w ISO15022 i *PlcOfTrad* w ISO20022.
- **Tryb obrotu** (*TradMode*) – max 16 znaków (*planowane wykorzystanie 4-znakowych kodów*)
Pole opcjonalne.
Pole wykorzystywane tylko w przypadku konieczności przekazania dodatkowych informacji o charakterystyce transakcji lub rozrachunku, wynikających z wymogów regulacyjnych, tabeli opłat, szczególnych wymogów operacyjnych itp.
Czteroznakowe kody stosowane w tym polu będą określane przez KDPW.
Do przekazywania informacji o trybie obrotu w komunikatach ISO wykorzystywane będzie pole *22F::STCO - Settlement Transaction Condition* w ISO15022 i *SttlmTxCond* w ISO20022.

W nowym rozwiązaniu nie przewiduje się stosowania atrybutu 'Faza operacji' (*TxPhs*).

Struktury komunikatów systemu kdpw_stream nie wymagają dostosowania do nowego sposobu oznaczania typów operacji rozrachunkowych. Wszystkie wymagane pola funkcjonują w obowiązujących aktualnie wersjach komunikatów.

W poniższej tabeli zaprezentowano pola komunikatów kdpw_stream wykorzystywane w dotychczasowym i nowym sposobie oznaczania typów operacji rozrachunkowych:

	Rozwiązanie dotychczasowe	Nowe rozwiązanie
<i>Typ operacji</i>	<KDPWStlmTxTp> TR </KDPWStlmTxTp>	<StlmTxTp> TRAD </StlmTxTp>
<i>Kod rynku</i>	<KDPWPlacOfTrad> XG </KDPWPlacOfTrad>	<PlacOfTrad> EXCH/XWAR </PlacOfTrad>
<i>Tryb obrotu</i>	<KDPWTradMode> ZG </KDPWTradMode>	<TradMode> GTDL </TradMode>
<i>Faza operacji</i>	<TxPhs> OPEN </TxPhs>	<i>Brak odpowiednika</i>

Nowy sposób oznaczania typów operacji rozrachunkowych w systemie kdpw_stream odpowiada w sposób bezpośredni zasadom obowiązującym w komunikatach ISO15022/ISO20022, co ilustruje poniższa tabela:

	Komunikaty własne XML	ISO15022 (SWIFT MT)	ISO20022
<i>Typ operacji</i>	<SttlmTxTp> TRAD </SttlmTxTp>	:22F::SETR//TRAD	<SctiesTxTp> <Cd> TRAD </Cd> </SctiesTxTp>
<i>Kod rynku</i>	<PlacOfTrad> EXCH/XWAR </PlacOfTrad>	:94B::TRAD//EXCH/XWAR	<PlcOfTrad> <Id> <MktldrCd>XWAR</MktldrCd> </Id> <Tp> <Cd>EXCH</Cd> </Tp> </PlcOfTrad>
<i>Tryb obrotu</i>	<TradMode> EXWA </TradMode>	:22F::STCO/KDPW/EXWA	<SttlmTxCond> <Prtry> <Id>GTDL</Id> <Issr>KDPW</Issr> </Prtry> </SttlmTxCond>

3. Sposób oznaczania typów operacji dla wybranych procesów rozrachunkowych

3.1 Transakcja OTC

Poniższy przykład przedstawia instrukcję rozrachunku dotyczącą transakcji OTC zawartej pomiędzy uczestnikami AAAA i BBBB:

```
<sese.ins.001.02>
<GnlInf>
  <InstrTp>DP</InstrTp>
  <SndrMsgRef>A_INS1</SndrMsgRef>
  <FuncOfMsg>NEWM</FuncOfMsg>
</GnlInf>
<TradDtls>
  <ISIN>PL1234567890</ISIN>
  <ReqdSttlmQty>
    <Unit>1100</Unit>
  </ReqdSttlmQty>
</TradDtls>
<SttlmDtls>
  <SttlmTxTp>TRAD</SttlmTxTp>
  <SttlmDtTm>
    <Dt>2015-11-18</Dt>
  </SttlmDtTm>
  <DlvrgSdDtls>
    <DlvrgAgtDtls>
      <KDPWMmbld>AAAA</KDPWMmbld>
      <KDPWSafAcct>ABCD</KDPWSafAcct>
    </DlvrgAgtDtls>
  </DlvrgSdDtls>
  <RcvgSdDtls>
    <RcvgAgtDtls>
      <KDPWMmbld>BBBB</KDPWMmbld>
      <KDPWSafAcct>1213</KDPWSafAcct>
    </RcvgAgtDtls>
  </RcvgSdDtls>
  <SttlmAmt Ccy="PLN">200000.4</SttlmAmt>
</SttlmDtls>
</sese.ins.001.02>
```

Jak wynika z powyższego przykładu, jedynym atrybutem wystarczającym do oznaczenia rodzaju operacji w tym przypadku jest pole *SttlmTxTp* o wartości **TRAD**. Instrukcja nie zawiera wskazania kodu obrotu ani kodu rynku.

3.2 Transakcje wymagające wyróżnienia fazy otwarcia i zamknięcia

Wspólną cechą transakcji repo, tri-party repo, buy-sell back, pożyczek papierów wartościowych oraz składania zabezpieczeń jest potrzeba rozróżnienia operacji otwierającej i zamykającej.

Zgodnie z praktykami SMPG rozróżnienie takie dokonywane jest na podstawie zastosowanego typu operacji rozrachunku oraz typu instrukcji.

Podstawowe typy instrukcji w systemie kdpw_stream to:

- DP/DN - dla płatnego/niepłatnego dostarczenia papierów (DvP, DFP),
- PP/PN – dla płatnego/niepłatnego przyjęcia papierów (RvP, DFP).

W zależności od scenariusza i fazy operacji, w instrukcji rozrachunku należy wskazać następujące wartości typu operacji oraz typu instrukcji:

<i>Typ operacji</i>	<i>Typ instrukcji</i>	<i>Opis</i>
Transakcje repo		
REPU	DP	Otwarcie repo – strona przekazująca zabezpieczenie
RVPO	PP	Otwarcie repo – strona dostarczająca środki pieniężne
REPU	PP	Zamknięcie repo – strona zwracająca środki pieniężne
RVPO	DP	Zamknięcie repo – strona zwracająca zabezpieczenie
Tri-party repo		
TRPO	DP	Otwarcie repo – strona przekazująca zabezpieczenie
TRVO	PP	Otwarcie repo – strona dostarczająca środki pieniężne
TRPO	PP	Zamknięcie repo – strona zwracająca środki pieniężne
TRVO	DP	Zamknięcie repo – strona zwracająca zabezpieczenie
Buy-sell back / sell-buy back		
SBBK	DP	Otwarcie – strona sprzedająca
BSBK	PP	Otwarcie – strona kupująca
SBBK	PP	Zamknięcie – strona sprzedająca
BSBK	DP	Zamknięcie – strona kupująca
Operacje pożyczek papierów wartościowych		
SECL	DN	Otwarcie pożyczki – pożyczkodawca
SECB	PN	Otwarcie pożyczki – pożyczkobiorca
SECL	PN	Zwrot pożyczki – pożyczkodawca
SECB	DN	Zwrot pożyczki – pożyczkobiorca
Operacje składania/ zwalniania zabezpieczeń		
COLO	DN	Przekazanie zabezpieczenia (dawca)
COLI	PN	Przyjęcie zabezpieczenia (biorca)
COLO	PN	Zwrot przekazanego zabezpieczenia (dawca)
COLI	DN	Zwrot przyjętego zabezpieczenia (biorca)

Dla instrukcji wymagających zestawienia w zakresie powyższych kodów operacji obowiązywać będzie krzyżowe zestawianie następujących wartości:

REPU <-> RVPO

TRPO <-> TRVO

SBBK <-> BSBK

SECL <-> SECB

COLI <-> COLO

3.3 Zdarzenia korporacyjne i operacje na papierach

Instrukcje rozrachunku powstałe w wyniku obsługi zdarzeń korporacyjnych i operacji na papierach będą oznaczane typem operacji **CORP** niezależnie od rodzaju zdarzenia. Powiązanie instrukcji z konkretnym zdarzeniem odbywa się poprzez wskazanie identyfikatora zdarzenia w polu: *CARef*, o ile taki identyfikator został nadany, oraz typu zdarzenia w polu *CaCd*.

Przewiduje się stosowanie następujących kodów typów zdarzeń korporacyjnych/operacji na papierach w polu *CaCd*:

- CONV – konwersja wszystkich papierów wartościowych oznaczonych kodem ISIN
- PARI – asymilacja wszystkich papierów wartościowych oznaczonych kodem ISIN
- EXRI – wykonanie prawa poboru
- RHDI – dystrybucja praw poboru
- SPLF - split
- SPLR - scalenie
- REDM – wykup
- CHAN, WRTH – wycofanie p.w

4. Lista operacji rozrachunkowych systemu kdpw_stream

Poniższa tabela zawiera nowe oznaczenia operacji rozrachunkowych obsługiwanych w systemie kdpw_stream. Lista rodzajów operacji została opracowana na podstawie Szczegółowych Zasad Działania KDPW obowiązujących od dnia 1.01.2016 r.

Kody operacji rozrachunku obsługiwanych w KDPW:

TRAD – rozrachunek transakcji

REPU – operacja repo

RVPO – operacja reverse repo

SBBK – operacja sell/buy-back

BSBK – operacja buy/ sell-back

TRPO – operacja tri-party repo

TRVO - operacja tri-party reverse repo

SECL – operacja udzielenia pożyczki papierów wartościowych

SECB – operacja pobrania pożyczki papierów wartościowych

CORP – rozrachunek związany z obsługą zdarzenia korporacyjnego lub operacji na papierach

COLI – przyjęcie zabezpieczenia

COLO – złożenie zabezpieczenia

PLAC – rejestracja instrumentów finansowych

REDI – wycofanie papierów wartościowych

PORT – transfer portfela

OWNI – transfer wewnętrzny (w ramach jednej instytucji)

OWNE – transfer zewnętrzny (z udziałem więcej niż jednej instytucji)

CNCB – operacja banku centralnego

CLAI – transfer wynikający z operacji ‘market claim’

MKUP – operacja mark-up

MKDW – operacja mark-down

INTP – zmiana statusów aktywów (wewnętrzny kod KDPW)

- Jeżeli w poniższych tabelach nie podano inaczej, przeniesienia papierów związane z rozrachunkiem pieniężnym dokonywane są na sesjach 1-3, a bez rozrachunku pieniężnego na sesjach 1-4.
- Jeżeli nie podano inaczej, rozrachunek operacji danego rodzaju w czasie rzeczywistym, (o ile jest prowadzony w tym systemie) dokonywany jest w godzinach 8:00-17:00 dla przeniesienia papierów związanego z rozrachunkiem pieniężnym oraz w godzinach 8:00-18:30 dla przeniesienia papierów niezwiązanego z rozrachunkiem pieniężnym.

Poszczególnym rodzajom operacji wymagającym potwierdzenia warunków rozrachunku nadaje się następujące oznaczenia:

Pozycja	Rodzaj operacji	Typ operacji	Kod rynku	Tryb obrotu	RTGS	Sesje rozrachunkowe	Uwagi	Dotychczasowe oznaczenie: - typ operacji - kod rynku - tryb obrotu - faza operacji (dotychczasowa pozycja na liście operacji)
1	<p>a) Transakcja zawarta poza obrotem zorganizowanym, realizowana przez Krajowy Depozyt,</p> <p>b) Zarejestrowanie papierów wartościowych, o których mowa w § 40 ust.6 Regulaminu,</p> <p>c) Wyrejestrowanie papierów wartościowych z kont ewidencyjnych prowadzonych w Krajowym Depozycie w związku z ich transferem na rynek zagraniczny</p>	TRAD			<p>DvP: 8.00-17.00 FoP: 8.00-18.30</p> <p>FoP: 8.00-18.30</p> <p>FoP: 8.00-18.30</p>	<p>DvP: 1-3 FoP: 1-4</p> <p>FoP: 1-4</p> <p>FoP: 1-4</p>	<p>b-e konieczne wskazanie właściwego miejsca rozrachunku (place of settlement)</p>	<p>TR-NR-ZN (95, 96)</p> <p>TR-IN-ZN (97)</p> <p>WZ-IN-ZN-CLO1 (65a)</p> <p>TR-IN-ZN (60)</p>

	<p>d) Zarejestrowanie bonów skarbowych zgodnie z § 40a ust. 2 Regulaminu</p> <p>e) Wyrejestrowanie bonów skarbowych z kont ewidencyjnych prowadzonych w Krajowym Depozycie w związku z ich wytransferowaniem z konta pomocniczego prowadzonego dla Krajowego Depozytu w Narodowym Banku Polskim</p>				-	FoP: 1-4		RZ-IN-ZN (85b)
					FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-4		WZ-IN-ZN-CLO1 (65b)
2	Przeniesienie papierów związanych z rozrachunkiem posttransakcyjnym	TRAD	KDPW/XPXX		DvP: 8.00-17.00 FoP: 8.00-18.30	DvP: 1-3 FoP: 1-4	Obecnie w RTGS od 16.30	TR-XP-ZN (93, 94)
3	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami uczestników dokonywane w związku z rozrachunkiem transakcji zawartej w ramach przetargu sprzedaży obligacji skarbowych albo przetargu sprzedaży obligacji emitowanych przez Bank Gospodarstwa Krajowego, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa, w przypadku gdy stroną tej transakcji jest uczestnik przetargu nie będący uczestnikiem bezpośrednim	TRAD	PRIM/NBPX		DvP:10.00-15.45	-		TR-NB-SW (88)
4	Rejestracja papierów wartościowych w związku z ich transferem z rynku brytyjskiego (w przypadku gdy są one rejestrowane na rynku brytyjskim w postaci tzw. <i>CREST Depository Interests (CDI)</i>)	MKUP			FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-4		MU-IN-ZN (75)

5	Zgłoszenie papierów wartościowych do wyrejestrowania w związku z ich transferem na rynek brytyjski, w przypadku gdy papiery te mają być rejestrowane na rynku brytyjskim w postaci tzw. <i>CREST Depository Interests (CDI)</i>	MKDW			FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-4		MD-IN-ZN-SUBS (11)
6	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami prowadzonymi dla różnych uczestników, inne niż przeniesienia określone w innych pozycjach	OWNE			FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-4		OE-IN-ZN (13) OT-IN-ZN (14) OI-IN-ZN (15-16) TR-RP-PS (58)
7	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami prowadzonymi dla tego samego uczestnika, inne niż przeniesienia określone w innych pozycjach	OWNI			FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-4		OW-IN-ZN (18)
8	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami prowadzonymi dla różnych uczestników, które nie prowadzi do przeniesienia własności tych papierów	PORT			FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-4		PT-IN-ZN (24)
9	Transakcja przeprowadzana w ramach transakcji repo realizowanej bez pośrednictwa KDPW	REPU/ RVPO			DvP: 8.00-17.00	DvP: 1-3		TR-NR-ZR-OPEN RE-NR-ZR-CLOS (96a, 96b)
10	Transfer papierów wartościowych wynikający z bieżących rozrachunków w ramach usługi repo bez pośrednictwa KDPW	COLI/ COLO		REPU	Fop: 8.00-18.30	DvP: 1-4		
11	Transakcja przeprowadzana w ramach transakcji	SBBK/			DvP: 8.00-17.00	DvP: 1-3		TR-NR-ZB-

	sell/buy-back realizowanej bez pośrednictwa KDPW	BSBK						OPEN RE-NR-ZN- CLOS (96c, 96d)
12	Rozrachunek repo przeprowadzany w ramach usługi tri-party repo, w tym transfer pieniężny przeprowadzany w ramach tej usługi.	TRPO/ TRVO			-	DvP: 1-3		RE-NR-ZN- OPEN RE-NR-ZN- CLOS (84a, 84b, 111)
13	Transfer wynikający z bieżących rozrachunków w ramach usługi tri-party repo, w tym transfer pieniężny przeprowadzany w ramach tej usługi.	COLI/CO LO		TRPO	-	DvP: 1-3		RE-NR-ZN (84c, 111)
14	Przeniesienie papierów wartościowych w związku z umową pożyczki zawartą poza systemami pożyczek organizowanymi przez Krajowy Depozyt	SECL/ SECB			DvP: 8.00-17.00 FoP: 8.00-18.30	DvP: 1-3 FoP: 1-4		TP-IN-ZN (86a, 86b)
15	Rejestracja papierów w trybie par. 40 ust. 5 Regulaminu	TRAD	PRIM		DvP: 8.00-17.00 FoP: 8.00-18.30	DvP: 1-3 FoP: 1-4		RZ-IN-ZN (85a, 86) ZW-IN-ZN (73, 74)
16	Wyrejestrowanie papierów wartościowych z kont uczestników, realizowane w trybie § 40 ust.5 Regulaminu	REDI			-	DvP: 1-3 FoP: 1-4		WZ-IN-ZN (98, 99)
17	Wykonanie uprawnień wynikających z obligacji zamiennych, obligacji z prawem pierwszeństwa albo warrantów subskrypcyjnych, realizowane w trybie § 40 ust.5 Regulaminu	REDI		EXWA	-	DvP: 1-3 FoP: 1-4		ZW-IN-ZN (100, 101)

18	Przeniesienie papierów wartościowych w związku z systemem gwarantowania rozliczeń prowadzonym przez KDPW_CCP:	COLI/ COLO				FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-3		MS-IN-ZN (101a, 101b, 74b, 74c)
----	---	---------------	--	--	--	-----------------	----------	--	---------------------------------------

Poszczególnym rodzajom operacji wymagającym potwierdzenia warunków rozrachunku przez BondSpot S.A. oraz przez obie strony rozrachunku nadaje się następujące oznaczenia:

Pozycja	Rodzaj operacji	Typ operacji	Kod rynku	Tryb obrotu	RTGS	Sesje rozrachunkowe	Uwagi	Dotychczasowe oznaczenie: - typ operacji - kod rynku - tryb obrotu - faza operacji (dotychczasowa pozycja na liście operacji)
19	Transakcja zawarta w obrocie wtórnym na prowadzonym przez BondSpot S.A. elektronicznym rynku skarbowych papierów wartościowych	TRAD	EXCH/TBSP		-	DvP: 1-3		TR-MT-ZN (54, 87, 102)
20	Transakcja przeprowadzana w ramach transakcji repo zawartej w obrocie na rynku elektronicznym organizowanym przez BondSpot S.A.	REPU/ RVPO	EXCH/TBSP			DvP: 8.00-17.00	DvP: 1-3	RE-MT-ZN- OPEN RE-MT-ZN- CLOS (26, 27, 80,

								80a, 103, 103a)
21	Transakcja przeprowadzana w ramach transakcji sell/buy-back zawartej w obrocie na rynku elektronicznym organizowanym przez BondSpot S.A.	SBBK/ BSBK	EXCH/TBSP		DvP: 8.00-17.00	DvP: 1-3		RE-MT-ZN-OPEN RE-MT-ZN-CLOS (26, 27, 80, 80a, 103, 103a)
22	Rozrachunek repo przeprowadzany w ramach usługi tri-party repo dla transakcji zawieranych w obrocie na rynku elektronicznym prowadzonym przez BondSpot S.A., w tym transfer pieniężny przeprowadzany w ramach tej usługi.	TRPO/ TRVO	EXCH/TBSP		-	DvP: 1-3		RE-MT-TR-OPEN RE-MT-TR-CLOS (103b, 103c, 112)
23	Transfer wynikający z bieżących rozrachunków w ramach usługi tri-party repo dla transakcji zawieranych w obrocie na rynku elektronicznym prowadzonym przez BondSpot S.A., w tym transfer pieniężny przeprowadzany w ramach tej usługi.	COLI/ COLO	EXCH/TBSP	TRPO	-	DvP: 1-3		RE-MT-ZN (84d, 112)

Poszczególnym rodzajom operacji nie wymagającym potwierdzenia warunków rozrachunku, nadaje się następujące oznaczenia:

Pozycja	Rodzaj operacji	Typ operacji	Kod rynku	Tryb obrotu	RTGS	Sesje rozrachunkowe	Uwagi	Dotychczasowe oznaczenie: - typ operacji - kod rynku - tryb obrotu
---------	-----------------	--------------	-----------	-------------	------	---------------------	-------	---

								- faza operacji (dotychczasowa pozycja na liście operacji)
24	Transakcja giełdowa na rynku nie będącym rynkiem instrumentów pochodnych, której rozrachunek jest zabezpieczony funduszem rozliczeniowym albo funduszem rozliczeniowym KDPW	TRAD	EXCH/XWAR		-	DvP: 1-3		TR-XG-ZG (36)
25	Transakcja giełdowa zawarta poza sesją giełdową Transakcja giełdowa w trybie nabycia znacznego pakietu akcji	TRAD	EXCH/XWAR	TRPK	-	DvP: 1-3		TR-XG-PK TR-XG-ZP (39, 41)
26	Transakcja zawarta w ramach publicznej sprzedaży przeprowadzonej za pośrednictwem Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.	TRAD	EXCH/XWAR	TRSW	-	DvP: 1-3		TR-XX-SW (40)
27	Transakcja odkupu lub odsprzedaży papierów wartościowych zawarta na rynku giełdowym w celu prawidłowego wykonania zobowiązań wynikających z rozliczenia innych transakcji,	TRAD	EXCH/XWAR	BISO	-	DvP: 1-3		TR-XG-BI (42)
28	Transakcja zawarta na podstawie zlecenia złożonego w ramach subskrypcji papierów wartościowych realizowanej przy wykorzystaniu systemu informatycznego Giełdy Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.	TRAD	PRIM/XWAR		-	DvP: 1-3		TR-XX-PS (43)
29	Transakcja zawarta w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w	TRAD	EXCH/XNCO		-	DvP: 1-3		TR-XA-ZG (44)

	Warszawie S.A. której rozrachunek jest zabezpieczony funduszem zabezpieczającym ASO albo funduszem zabezpieczającym ASO KDPW							
30	- Transakcja pakietowa zawarta w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. - Transakcja w trybie nabycia znacznego pakietu akcji zawarta w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.	TRAD	EXCH/XNCO	TRPK	-	DvP: 1-3		TR-XA-PK TR-XA-ZP (45, 47)
31	Transakcja odkupu lub odsprzedaży papierów wartościowych zawarta w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. w celu prawidłowego wykonania zobowiązań wynikających z rozliczenia innych transakcji,	TRAD	EXCH/XNCO	BISO	-	DvP: 1-3		TR-XA-BI (46)
32	Transakcja pakietowa zawarta na regulowanym rynku pozagiełdowym	TRAD	EXCH/RPWC	TRPK	-	DvP: 1-3		TR-XC-PK TR-XC-ZP (48, 50)
33	Transakcja zawarta na regulowanym rynku pozagiełdowym, której rozrachunek jest zabezpieczony funduszem rozliczeniowym albo funduszem rozliczeniowym KDPW	TRAD	EXCH/RPWC		-	DvP: 1-3		TR-XC-ZG (51)
34	Transakcja zawarta w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez BondSpot S.A., której rozrachunek jest zabezpieczony funduszem zabezpieczającym ASO albo funduszem zabezpieczającym ASO KDPW	TRAD	EXCH/BOSP		-	DvP: 1-3		TR-XM-ZG (52)

35	Transakcja pakietowa zawarta w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez BondSpot S.A.	TRAD	EXCH/BOSP	TRPK	-	DvP: 1-3		TR-XM-ZP (53)
36	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami uczestników dokonywane w związku z rozrachunkiem transakcji zawartej w ramach przetargu odkupu obligacji skarbowych albo przetargu odkupu obligacji emitowanych przez Bank Gospodarstwa Krajowego, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa.	TRAD	SECM/NBPX		-	DvP: 1-2		TR-NB-ZN (55)
37	a) Transakcja sprzedaży bankowi albo zakupu od banku skarbowych papierów wartościowych, realizowana przez Narodowy Bank Polski w trybie aukcyjnym w ramach prowadzonej polityki pieniężnej, b) Transakcja sprzedaży bankowi albo zakupu od banku skarbowych papierów wartościowych, realizowana przez Narodowy Bank Polski w trybie pozaprzetargowym w ramach prowadzonej polityki pieniężnej.	TRAD	SECM/NBPX	TRPP	-	DvP: 1		TR-NB-PP (55a)
38	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami uczestników dokonywane w związku z rozrachunkiem transakcji zawartej w ramach przetargu zamiany obligacji skarbowych albo przetargu zamiany obligacji emitowanych przez Bank Gospodarstwa Krajowego, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa - odkup	TRAD	SECM/NBPX		-	FoP: 1-4		TR-NB-ZN (56)
39	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami uczestników dokonywane w związku z rozrachunkiem transakcji zawartej w ramach przetargu zamiany obligacji skarbowych albo przetargu zamiany	TRAD	PRIM/NBPX		-	FoP: 1-4		TR-NB-ZN (56)

	obligacji emitowanych przez Bank Gospodarstwa Krajowego, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa - przydział							
40	Przeniesienie papierów wartościowych pomiędzy kontami uczestników dokonywane w związku z rozrachunkiem transakcji zawartej w ramach przetargu sprzedaży obligacji skarbowych albo przetargu sprzedaży obligacji emitowanych przez Bank Gospodarstwa Krajowego, poręczanych lub gwarantowanych przez Skarb Państwa.	TRAD	PRIM/NBPX		DvP: 10.00-15.45	-		TR-NB-SW (57)
41	Przymusowy wykup akcji spółki publicznej, o którym mowa w art. 82 ust. 1 ustawy o ofercie publicznej	TRAD			-	DvP: 1-3		TR-IN-ZN (59)
42	Dostawa instrumentu bazowego w związku z wykonaniem instrumentów pochodnych	OWNE	SECM/KDPW		-	FoP: 1-3		TR-DV-ZG (60b)
43	Transakcja repo, której rozrachunek następuje na podstawie instrukcji rozrachunku dostarczonej przez KDPW_CCP	REPU/RV PO	OTCO/KDPW		-	DvP: 1-3		TR-OC-ZG (60a)
44	Transakcja sell/ buy-back, której rozrachunek następuje na podstawie instrukcji rozrachunku dostarczonej przez KDPW_CCP	SBBK/ BSBK	OTCO/KDPW		-	DvP: 1-3		TR-OC-ZG (60a)
45	Instrukcja rozrachunku powstała w wyniku obsługi zdarzenia korporacyjnego lub operacji na papierach	CORP			8.00-18.30	R, 1-4		AS-IN-ZN CH-IN-ZN PP-IN-ZN- 0001 PP-IN-ZN- 0002 PP-IN-ZN-

								0003 PP-IN-ZN- 0004 RZ-IN-ZN- OPEN WY-IN-ZN WZ-IN-ZN (1, 6, 20, 21, 22, 23a, 34, 64, 66)
46	Rejestracja instrumentów finansowych	PLAC			FoP: 8.00-18.30	DvP: 1-3 FoP: 1-4		RZ-IN-ZN (33) PP-IN-ZN (23b)
47	Wyrejestrowanie papierów wartościowych z kont uczestników	REDI		CLOS	FoP: 8-18.30	FoP: 1-4		WZ-IN-ZN CLOS (67)
48	Udzielenie i zwrot automatycznej pożyczki papierów wartościowych	SECB/ SECL		AUTO	-	DvP: 1-3		BO-IN-ZN- OPEN BO-IN-ZN- CLOS (2, 3, 9, 10)
49	Rozrachunek związany z udzieleniem pożyczki zawartej w ramach systemu pożyczek negocjowanych Rozrachunek związany ze zwrotem pożyczki zawartej w ramach systemu pożyczek negocjowanych	SECB/ SECL		PNEG	-	DvP: 1-3		LB-PN-ZN- OPEN LB-PN-ZG- CLOS (7, 7a)

50	Substytucja pożyczkodawcy	SECB/ SECL		SUBS	-	FoP: 1-3		LE-IN-ZN- SUBS (8)
51	Transakcja przeprowadzana w ramach transakcji repo zawartej pomiędzy Narodowym Bankiem Polskim a bankiem.	REPU/ RVPO	OTCO/NBPX		Otwarcie: 8.00- 17:00 Zamknięcie: 8.00- 11:00	DvP: 1		RE-NB-ZN- OPEN RE-NB-ZN- CLOS (28, 29)
52	Przeniesienie papierów wartościowych na konto Narodowego Banku Polskiego tytułem zabezpieczenia kredytu technicznego Przeniesienie papierów wartościowych na konto uczestnika KDPW z konta Narodowego Banku Polskiego w związku ze spłatą kredytu technicznego	CNCB			Wniesienie: 8.00- 17.15 Zwrot: 8.00-18.30	Wniesie nie: 1-3 Zwrot: 1-4		CB-IN-ZN CB-NB-ZN (4, 5)
53	Przekazanie zabezpieczenia pożyczki papierów wartościowych pożyczkodawcy	COLI/ COLO			-	FoP 1-3		TZ-IN-ZN (61)
54	Transfer papierów wartościowych przekazanych na poczet właściwych depozytów zabezpieczających realizowany na zlecenie uczestnika	COLI/ COLO			FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-3		TZ-IN-ZN (62a)
55	Operacja zmiany statusu papierów wartościowych	INTP			FoP: 8.00-18.30	FoP: 1-4		ZS-IN-ZN (69, 70)

Poszczególnym rodzajom operacji polegającym wyłącznie na transferze środków pieniężnych, nadaje się następujące oznaczenia:

Pozycja	Rodzaj operacji	Typ operacji	Kod rynku	Tryb obrotu	RTGS	Sesje rozrachunkowe	Uwagi	Dotychczasowe oznaczenie: - typ operacji - kod rynku - tryb obrotu - faza operacji (dotychczasowa pozycja na liście operacji)
56	Transfer pieniężny w związku z rozrachunkiem transakcji dokonany na podstawie § 50 Regulaminu. Transfer związany z obsługą rekompensat, o których mowa w § 68 Regulaminu	CLAI			-	1-3		KP-IN-ZN (104) KR-IN-ZN (113)
57	Transfer pieniężny w związku z pobraniem odstępnego na skutek odstąpienia przez uczestnika od transakcji zawartej w ramach organizowanego przez Ministra Finansów przetargu odkupu albo przetargu zamiany obligacji skarbowych.	OWNE		INTR	8.00-15:45	-		DP-IN-ZN (105)
58	Transfer pieniężny w związku z: - uzupełnieniem niedoboru lub zwrotem nadwyżki zabezpieczenia umownego pożyczki negocjowanej, lub - w związku przejściem zabezpieczenia umownego pożyczki negocjowanej przez KDPW_CCP	COLI/ COLO		PNEG	-	1-3		ZP-IN-ZN (106)

59	Transfer pieniężny w związku z obsługą zabezpieczeń automatycznych pożyczek papierów wartościowych	COLI/ COLO		AUTO	-	1-3		BP-IN-ZN (108)
60	Transfer pieniężny związany z wykonaniem świadczenia pieniężnego wynikającego z transakcji zawartej poza obrotem zorganizowanym, które zostało ustalone na podstawie instrukcji dostarczonej przez KDPW_CCP	COLI/ COLO		CCPT	-	1-3		IP-OC-ZG (109)

5. Okres przejściowy

Instrukcje rozrachunku przekazane do systemu kdpw_stream przed datą wdrożenia nowych oznaczeń, a przewidziane do rozrachunku po dacie wdrożenia powinny zawierać dotychczasowe oznaczenia typów operacji.

Komunikaty statusu i potwierdzeń rozrachunku dla takich instrukcji przekazywane po dacie wdrożenia będą zawierać nowe oznaczenia typów operacji.

Załącznik 1 – Lista typów operacji w komunikatach ISO20022

Poniżej przedstawiono listę kodów operacji rozrachunkowych zdefiniowanych w komunikatach ISO20022.

Kody stosowane w systemie kdpw_stream powinny stanowić podzbiór wartości z poniższej listy.

AUTO	AutoCollateralisation	Relates to an auto-collateralisation movement
BSBK	Buy Sell Back -	Relates to a buy sell back transaction.
CLAI	Market Claim	Transaction resulting from a market claim.
CNCB	Central Bank Collateral Operation	Relates to a collateral delivery/receipt to a National Central Bank for central bank credit operations.
COLI	Collateral In	Relates to a collateral transaction, form the point of view of the collateral taker or its agent.
COLO	Collateral Out	Relates to a collateral transaction, form the point of view of the collateral giver or its agent.
CONV	DR Conversion	Relates to a depository receipt conversion.
CORP	Corporate action	Relates to a corporate action
ETFT	Exchange Traded Funds	Relates to an exchange traded fund (ETF) creation or redemption.
FCTA	Factor Update	Relates to a factor update.
INSP	Move of Stock	Relates to a movement of shares into or out of a pooled account.
ISSU	Issuance	Relates to the issuance of a security such as an equity or a depository receipt.
MKDW	Mark-Down	Relates to the decrease of positions held by an ICSD at the common depository due to custody operations (repurchase, pre-release, proceed of corp. event realigned).
MKUP	Mark-Up	Relates to the increase of positions held by an ICSD at the common depository due to custody operations (repurchase, pre-release, proceed of corporate event realigned).
NETT	Netting	Relates to the netting of settlement instructions.
NSYN	Non Syndicated	Relates to the issue of medium and short term paper (CP, CD, MTN, notes ...) under a program and without syndication arrangement.
OWNE	External Account Transfer	Relates to an account transfer involving more than one instructing party (messages sender) and/or account servicer (messages receiver).
OWNI	Internal Account Transfer	Relates to an account transfer involving one instructing party messages sender at one account servicer (messages receiver).
PAIR	Pair-Off	Relates to a pair-off: the transaction is paired off and netted against one or more previous transactions.
PLAC	Placement	Relates to the placement/new issue of a financial instrument.
PORT	Portfolio Move	Relates to a portfolio move from one investment manager to another and/or from an account servicer to another. It is generally charged differently than another account transfer (OWNE, OWNI, INSP), hence the need to identify this type of transfer as such.
REAL	Realignment	Relates to a realignment of positions.
REDI	Withdrawal	Relates to the withdrawal of specified amounts from specified subaccounts.
REDM	Redemption (Funds)	Relates to a redemption of Funds (Funds Industry ONLY).
RELE	DR Release/Cancellation	Relates to a release (into/from local) of Depository Receipt operation.
REPU	Repo	Relates to a repurchase agreement transaction.
RODE	Return of Delivery Without Matching	Relates to the return of financial instruments resulting from a rejected delivery without matching operation.
RVPO	Reverse Repo	Relates to a reverse repurchase agreement transaction.
SBBK	Sell Buy Back	Relates to a sell buy back transaction.
SBRE	Borrowing Reallocation	Internal reallocation of a borrowed holding from one safekeeping account to another.
SECB	Securities Borrowing	Relates to a securities borrowing operation.
SECL	Securities Lending	Relates to a securities lending operation.
SLRE	Lending Reallocation	Internal reallocation of a holding on loan from one safekeeping account to another.
SUBS	Subscription (Funds)	Relates to a subscription to funds (Funds Industry ONLY).
SYND	Syndicate of Underwriters	Relates to the issue of financial instruments through a syndicate of underwriters and a Lead Manager.
TBAC	TBA Closing	Relates to a To Be Announced (TBA) closing trade.
TRAD	Trade	Relates to the settlement of a trade.
TRPO	Triparty Repo	Relates to a triparty repurchase agreement.
TRVO	Triparty Reverse Repo	Relates to a triparty reverse repurchase agreement.
TURN	Turnaround	Relates to a turnaround: the same security is bought and sold to settle the same day, to or from different brokers.

Załącznik 2 – Kody operacji w standardach technicznych ESMA dotyczących CSDR

W ramach wymogów dotyczących tzw. 'record keeping' ESMA wymaga rozróżniania co najmniej następujących rodzajów operacji:

- a) **TRAD** - purchase or sale of securities;
- b) **COLI/COLO/CNCB** - collateral management operations;
- c) **SECL/SECB** - securities lending/borrowing operations;
- d) **REPU/RVPO/TRPO/TRVO/ BSBK/ SBBK** - repurchase transactions;
- e) **OTHR (or more granular codes as provided by the CSD)** - others.

Załącznik 3 – Definicja kodu rynku w komunikatach ISO150022/20022

TRAD Place of Trade Place at which the order was traded, directly by the instructing party or not.

FORMAT

:4!c/[8c]/4!c[/30x] (Qualifier)(Data Source Scheme)(PlaceCode)(Narrative)

Place Code must contain one of the following codes:

EXCH	Stock Exchange	Place of trade is a stock exchange.
OTCO	Over The Counter	Place of trade is over the counter.
PRIM	Primary Market	Place of trade is the primary market.
SECM	Secondary Market	Place of trade is the secondary market.
VARI	Various	Trade was executed on various places.

USAGE RULES

When Place Code is OTCO, Narrative, if present, must specify the system. When Place Code is EXCH, Narrative, if present, must specify the Market Identifier Code (MIC).

A cross-exchange netted transaction is to be identified by the combination of Various (Place field

:94B::TRAD//VARI) and Netting (Indicator field :22F::SETR//NETT).