

## Notatka ze spotkania

projekt: Wprowadzenie zmian w zakresie dyscypliny rozrachunku w związku z procesem autoryzacji KDPW

Data spotkania: 4.03.2022

### Uczestnicy:

1. Reprezentacja RBD
2. Reprezentacja IDM
3. Reprezentacja KDPW\_CCP
4. Reprezentacja KDPW

### Omawiane kwestie:

#### I Informacje bieżące

1. podsumowanie pierwszego miesiąca działania systemu kar pieniężnych
2. przygotowanie do raportów miesięcznych – w 14 PBD, tj. 18.03.2022
3. przygotowanie do realizacji płatności – w 17 PBD, tj. 23.03.2022
4. Stosowany formularz reklamacji – formularz U43 dostępny na stronie internetowej KDPW: <http://www.kdpw.pl/pl/Uczestnicy/CSDR-mechanizm-kar-pienieznych/Strony/default.aspx>
5. Interpretacja momentu cut-off – istotne dla naliczania kar w przypadku odwoływania instrukcji:
  - 1) jest to ostatni moment w trakcie dnia księgowego w systemie rozrachunku, podczas którego może nastąpić rozrachunek danego rodzaju operacji
  - 2) może to być różny moment czasowy, w zależności od rodzaju operacji (DvP czy FoP) czy też systemu rozrachunku (sesyjny i RTGS)
  - 3) czynności wykonywane po cut-off, np. odwołanie instrukcji, są traktowane jako wykonywane w kolejnym okresie – w szczególności odwołanie instrukcji DvP o godz. 17.30 w ISD nie zwalnia z naliczenia kary pieniężnej za brak rozrachunku w ISD
6. dyskusje na temat usunięcia art.19 RTS wskazującego na pobór i redystrybucje kar pieniężnych przez CCP w relacji do uczestników rozliczających – dyskusja trwa, trudno określić kiedy nastąpią zmiany i jaki będzie finalny kierunek
7. Pytanie czy KDPW może ustanowić limit, poniżej którego kary nie byłyby rozliczane – odpowiedź: nie jest to możliwe, kary muszą być naliczane dla każdej instrukcji, nawet jeśli opiewają na 1 grosz; bez tego nie bilansowałby się pozycje łączne wynikające z kar
8. Postulat uczestników – w przypadku dokonywania modyfikacji w zasadach wypełniania komunikatów systemowy należy powiadamiać o zakresie zmian.
9. Postulat, aby 'utworzyć' komunikat z rozliczeniem kar na styku z CCP – odpowiedź: w ocenie KDPW z raportu miesięcznego jest możliwość odczytania danych o wysokości płatności z CCP

#### II Wypełnianie danych o wolumenie transakcji w przypadku papierów dłużnych

1. w przypadku jeśli jedna ze stron rozrachunku poda wolumen w wartości nominalnej, to system zachowuje ten format jako właściwy dla danej operacji
2. w komunikacie karach pieniężnych pojawia się wartość będąca pochodną z instrukcji rozrachunku (wg. zasad z pkt1)
3. oznacza to, że wolumen może być wyrażone w wartości nominalnej (FaceAmt) lub w sztukach (Unit)
4. dyskusja o docelowym modelu
5. Konkluzja – docelowo należy podawać wolumen dla papierów dłużnych w postaci wartości nominalnej; zmiana wymaga dostosowań w systemie KDPW;

### **III Wypełnianie w komunikacie o karach pieniężnych pola <CdtDbt>**

1. Zasadniczo KDPW wypełnia tę informację wartością CTDI dla instrukcji typu DvP
2. jest to pochodna analogicznego atrybutu w komunikacie dot. statusu instrukcji rozrachunku
3. wartość DBIT stosowana tylko w przypadku przepływ papierów i gotówki są w tym samym kierunku (sytuacja możliwa przy nettingu w papierach wartościowych)
4. dyskusja o potencjalnych zmianach
5. Konkluzja – zmiana oceniana przez KDPW jako głęboka; będzie omawiana w ramach prac grupy nmpg.

### **IV Wypełnianie w komunikacie o karach pieniężnych pola ClssfctnTp (klasyfikacja instrumentu)**

1. Obecnie nie jest wypełniane
2. ISO20022 tego nie wymaga
3. Zgłoszone postulaty, aby CSD wypełniał to pole
4. dyskusja o potencjalnych zmianach
5. Konkluzja: KDPW dokona zmian, aby pole było wypełniane

### **V Wypełnianie w komunikacie o karach pieniężnych pola dot. CSD kontrahenta**

1. Obecnie wypełniane dla komunikatów dot. cross-CSD
2. W komunikatach tworzonych w KDPW jako calculating-CSD nie jest umieszczana ta wartość – zawsze dot. KDPW
3. Propozycja, aby pole było wypełniane kodem BIC KDPW
4. Dyskusja nt. możliwości wprowadzenia zmiany
5. Konkluzja: KDPW dokona zmian, aby pole było wypełniane, tj. będzie podawany kod BIC KDPW

### **VI Stosowana referencja w komunikacie kary dot. braku rozrachunku dłużej niż 1 dzień**

1. Sprawa dot. kar typu SEFP
2. KDPW każdego dnia nalicza odrębną karę dot. poszczególnych instrukcji i wysyła komunikat jako NEWM, nadając odrębny identyfikator kary
3. Komunikat z funkcją UPDT - stosowany w przypadku zmiany wcześniej naliczonej kary, np. na skutek reklamacji, zmiany ceny referencyjnej itp.
4. Postulat, aby w zawieszeniach trwających dłużej niż 1 dzień kolejny komunikat dot. tej samej instrukcji był w funkcji UPDT
5. Dyskusja nt. stosowanego modelu
6. Postulat wycofany – dla każdej kary, w przypadku jej naliczenia w stosunku do tej samej instrukcji w kolejnych dniach, jest stosowany wskaźnik NEWM;

### **VII Wypełnianie w komunikacie o karach pieniężnych pola SctiesMvmntTp**

1. W zakresie operacji podlegających zestawianiu sprawa oczywista:
  - 1) strona dostarczająca ma DELI
  - 2) strona otrzymująca RECE
2. W przypadku instrukcji niezestawianych w komunikatach dot. rozrachunku jest wskazywane zawsze DELI
3. Sprawa podobna do tematu z pkt III
4. Dyskusja o potencjalnych zmianach
5. Konkluzja – zmiana oceniana przez KDPW jako głęboka; będzie omawiana w ramach prac grupy nmpg.

## VIII Możliwość wprowadzenia hold-release w transferach międzysystemowych

1. Temat omawiany w przeszłości
2. Proces realizacji transferów międzysystemowych jest dwuetapowy:
  - 1) obsługa instrukcji w systemie KDPW – nie działa tu typowe zestawianie (a mechanizm HR jest w zasadzie ściśle związany z zestawianiem), lecz wykorzystywany jest mechanizm potwierdzania/akceptacji rozrachunku
  - 2) obsługa instrukcji w zagranicznym CSD, które dotyczą konta omnibus KDPW – tu z kolei działa zestawianie,
3. Potencjalny model:
  - 1) dopuszcza się dla określonych rodzajów operacji (transfery międzysystemowe) przekazanie instrukcji w statusie „hold”
  - 2) taka instrukcja jest jedynie przyjęta w systemie (nie odrzucana – jak obecnie), ale nie podlega dalszemu przetwarzaniu, tj. w szczególności nie jest wysyłana instrukcja do zagranicznego CSD w statusie „hold”
  - 3) zmiana statusu na „release” wyzwala dalsze procesowanie instrukcji wg. obecnie stosowanych zasad
  - 4) po uruchomieniu transferu nie jest dopuszczalne przywrócenie statusu „hold”
4. Pełny mechanizm – status hold przekazywany do zagranicznego CSD
5. Dyskusja o możliwości zmian:
  - 1) są oczekiwania klientów uczestników, aby możliwe było przekazywanie instrukcji dot. transferów międzysystemowych w stanie „hold”
  - 2) docelowo powinien być pełny mechanizm, czyli przekazywanie stanu „hold” do zagranicznego CSD
  - 3) w okresie przejściowym akceptowalnym rozwiązaniem jest „uproszczony” mechanizm wg. pkt 3 powyżej
6. Konkluzja – możliwie szybko wdrażać model uproszczony, a w dalszej kolejności model pełny

## IX Sprawy różne

1. Kwestie wymagające omówienia w ramach grupy nmpg – prośba ze strony uczestników, aby możliwie szybko zorganizować spotkanie nmpg.
2. Zapytanie czy w raporcie miesięcznym dot. kar pieniężnych jest możliwe wprowadzenie podziału na Id konta – w ocenie KDPW norma ISO20022 w teorii daje taką możliwość, ale w takim wypadku zostaje utracona inna wartość, czyli suma kar na całego uczestnika. Rozwiązanie KDPW jest analogiczne do stosowanego w T2S.