

SCP/ZW/8/2022
CCP/ZW/655/2022

Warszawa, 4 października 2022 r.

Uczestnicy KDPW
Uczestnicy KDPW_CCP
Uczestnicy RT EMIR
Uczestnicy RT SFTR
Uczestnicy ARM
Podmioty zainteresowane**dot.: zmian w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP zaplanowanych na 2023 r.**

Szanowni Państwo,

zgodnie z przyjętą od kilku lat praktyką, mającą na celu zwiększenie efektywności wdrożeń i umożliwienie Państwu zaplanowanie zmian w systemach informatycznych z odpowiednim wyprzedzeniem, poniżej przedstawiamy informację o naszych inicjatywach na 2023 r. związanych z modyfikacjami w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP, wynikającymi z rozwoju naszych usług lub dostosowaniem do nowych regulacji. Informacja obejmuje zarówno projekty, które planujemy wdrożyć w 2023 r. jak również te zakresy, które w 2023 r. będą na zaawansowanym etapie realizacji i będą związane z koniecznością zmian w Państwa systemach informatycznych w kolejnych latach.

W celu przybliżenia szczegółów związanych z planami na rok 2023, planujemy spotkanie z przedstawicielami organizacji zrzeszających uczestników, w tym w szczególności z przedstawicielami Rady Banków Depozytariuszy i Izby Domów Maklerskich, z przedstawicielami dostawców Państwa systemów informatycznych a także z uczestnikami, którzy nie należą do ww. Stowarzyszeń. Spotkanie on-line odbędzie się w dniu **25 października o g. 10:00** z użyciem MS Teams.

Zaproszenie na spotkanie prześlemy odrębną wiadomością, po skompletowaniu danych o uczestnikach spotkania. W sprawach organizacyjnych, w tym w sprawie zgłoszenia udziału w spotkaniu, prosimy o kontakt na adres: bozena.koziorynski@kdpw.pl do dnia 20 października br.

Zgodnie z zasadą wprowadzania zmian systemowych w ramach okien wdrożeniowych, po analizie zakresów i harmonogramów projektów, na **2023 rok** zaplanowaliśmy dwa terminy:

- wiosenne okno wdrożeniowe w terminie: **6 - 7 maja**,
- jesienne okno wdrożeniowe w terminie: **18 - 19 listopada**.

Lista projektów związanych ze zmianami w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP:

poniższa lista może ulec modyfikacji w przypadku zmian otoczenia zewnętrznego, w szczególności regulacyjnego i nowych potrzeb biznesowych.

WIOSENNE OKNO WDROŻENIOWE_6 - 7 maja 2023 r.

1. Wdrożenie obsługi zgłaszania limitu płatności w procesie rozrachunku w postaci komunikatów xml

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW – obligatoryjne dla stosujących tę funkcjonalność

Mając na uwadze usprawnienie procesu zgłaszania limitów płatności, zdefiniowanych w §84 Regulaminu KDPW, planowane jest wdrożenie rozwiązań umożliwiających zgłoszenie takiego limitu z wykorzystaniem dedykowanych komunikatów xml. Nowe rozwiązanie zastąpi obecną formę takiego „zastrzeżenia płatności” przekazywanego w formie tradycyjnej.

Materiały: Szczegółowe materiały, w tym struktury komunikatów, dotyczące projektowanych zmian, związanych z wdrożeniem nowych funkcjonalności prześlemy Państwu **do końca grudnia 2022 r.**

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy **od początku kwietnia 2023 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie planowane w terminie **6 - 7 maja 2023 r.**

JESIENNE OKNO WDROŻENIOWE_18 - 19 listopada 2023 r.

2. Wdrożenie standardów AMI-SeCo

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW – obligatoryjne

KDPW prowadzi prace projektowe związane z wdrożeniem standardów AMI-SeCo, dotyczących obsługi zdarzeń korporacyjnych, w ramach procesu harmonizacji zasad zarządzania zabezpieczeniami na rynku europejskim (Single Collateral Management Rulebook for Europe - SCoRE). W ramach projektu planowana jest rozbudowa istniejącego oprogramowania w zakresie wymiany informacji, w tym w zakresie komunikatów elektronicznych stosowanych do obsługi zdarzeń korporacyjnych. Wymiana informacji w zakresie wymienionych procesów będzie realizowana za pomocą komunikatów ISO 20022, w wersji aktualnie obowiązującej, których zawartość zostanie dostosowana do standardów AMI-SeCo. Przewiduje się także zmiany w zakresie interfejsu oferowanego przez KDPW na potrzeby obsługi wypłaty świadczeń z papierów wartościowych (aplikacja *Wypłata świadczeń*).

Materiały: Szczegółowe materiały dotyczące projektowanych zmian w systemach informatycznych KDPW, związanych z dostosowaniem do standardów AMI-SeCo przekazaliśmy Państwu pismami z dnia 8 kwietnia 2022 r. Nr BRB/ZW/7/2022 oraz z dnia 3 czerwca 2022 r. Nr BRB/ZW/13/2022.

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy etapowo, począwszy **od lipca 2023 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie standardów AMI-SeCo w zakresie zarządzania zabezpieczeniami (standardy Corporate Actions), planowane jest w terminie **18 - 19 listopada 2023 r.**

3. Wprowadzenie zmian w funkcjonalnościach procesu rozrachunku

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obligatoryjne

Mając na uwadze wsparcie procesów rozrachunku, w Grupie Kapitałowej KDPW powołany został projekt, którego głównym celem jest usprawnienie funkcjonalności procesu rozrachunku. W szczególności zakłada się wykonanie zmian w zakresie wprowadzenia możliwości skierowania do rozrachunku części wstrzymanego wcześniej zlecenia (partial release), wprowadzenia zmian w obsłudze instrukcji rozrachunku uzgodnionych na forum S&R NMPG PL (zasad stosowania znaczników do oznaczania kierunku przepływów środków pieniężnych oraz kierunek przepływu instrumentów finansowych) oraz wdrożenie mechanizmu hold-release w zakresie transferów międzysystemowych do innych CSD. Planujemy również ocenę możliwości implementacji mechanizmów pozwalających na dokonanie zmiany systemu rozrachunku (sesyjny – RTGS) w zakresie zestawionych zleceń.

Mając na uwadze dostosowanie zmian systemowych do potrzeb zgłaszanych przez uczestników rynku, planujemy zorganizować spotkania w ramach grupy roboczej S&R NMPG PL, aby we współpracy z przedstawicielami uczestników rynku wypracować oczekiwany zakres zmian w funkcjonalnościach procesu rozrachunku, które finalnie powinny być zaimplementowane w systemie kdpw_stream.

Materiały: Szczegółowe informacje dotyczące planowanych zmian w funkcjonalnościach procesu rozrachunku prześlemy Państwu oraz opublikujemy na stronach internetowych **w kwietniu 2023 r.**

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy począwszy **od września 2023 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie zmian w funkcjonalnościach procesu rozrachunku planowane jest w terminie **18 - 19 listopada 2023 r.**

INNE WAŻNE PROJEKTY, PLANOWANE DO WDROŻENIA W LATACH 2022 - 2024

(poza planowanym oknem wdrożeniowym), mogące mieć wpływ na Państwa systemy informatyczne:

4. Uruchomienie systemu rozliczeń kdpw_stream dla transakcji OTC

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW_CCP (obrot OTC) – obligatoryjne

W Grupie Kapitałowej KDPW finalizowany jest projekt mający na celu wytworzenie autorskiego systemu dedykowanego rozliczeniom derywatów OTC (zintegrowanego z kdpw_stream), który pozwoli na podniesienie standardu świadczonych usług rozliczeniowych (standaryzacja komunikatów, szybkość

działania, interfejs GUI, efektywna implementacja przyszłych zmian), a także wpłynie na efektywność i elastyczność rozwiązań w zakresie usług rozliczeniowych.

Materiały: Kompleksowy katalog komunikatów systemowych (opis procesów i struktury oraz liczne przykłady komunikatów FpML i XML), przekazaliśmy Państwu w materiałach informacyjnych (pismo CCP/ZW/242/2022 z dnia 31 marca 2022 r.).

Testy: Od maja 2022 r. udostępniliśmy środowisko testowe oraz rozpoczęliśmy testy nowego rozwiązania z udziałem uczestników KDPW_CCP (obrót OTC). Dodatkowo, od czerwca 2022 r. w środowisku testowym TSTB poprzez GUI, udostępniliśmy nowe funkcjonalności wspierające testy OTC. Natomiast we wrześniu 2022 r. w środowisku testowym udostępniony został ostatni z modułów systemu OTC – moduł aukcji.

Wdrożenie: Uruchomienie systemu rozliczeń kdpw_stream dla transakcji OTC nastąpi w terminie **17 - 18 grudnia 2022 r.**, a nie jak pierwotnie zakładano w dniach 22 - 23 października 2022 r.

5. Uruchomienie systemu uwierzytelniania dwuskładnikowego (MFA)

Obejmie wszystkie usługi oferowane w online.kdpw.pl

W celu podniesienia bezpieczeństwa usług, które spółki Grupy KDPW oferują swoim klientom za pośrednictwem Portalu usług - online.kdpw.pl prowadzony jest projekt wdrożenia mechanizmów wieloskładnikowego uwierzytelniania (tzw. model MFA – multifactor authentication). W tej chwili dostęp do aplikacji wymaga uwierzytelnienia z użyciem hasła, co stanowi tzw. atrybut wiedzy. Celem zwiększenia poziomu wiarygodności wprowadzony zostanie drugi czynnik uwierzytelniania, który będzie bazował na tzw. atrybucie posiadania. Oznacza to, że w procesie uwierzytelnienia użytkownik będzie musiał udowodnić, że posiada dostęp do zaufanego i przypisanego mu urządzenia. Urządzeniem zaufanym może być:

- Aplikacja mobilna (KDPW Group Authenticator) instalowana na urządzeniu mobilnym działającym w oparciu o system Android lub iOS.
- Zaufana przeglądarka internetowa, wykorzystywana na komputerze w określonej sieci i adresie IP, którą podczas logowania (po potwierdzeniu z wykorzystaniem aplikacji mobilnej) użytkownik oznaczy jako zaufaną.

Zarządzanie listą przypisanych do danego konta dostępowego urządzeń zdefiniowanych jako zaufane, możliwe jest z poziomu zarządzania kontem, przy wykorzystaniu dedykowanej strony <https://identity.kdpw.pl>. W ramach tej usługi możliwe będzie zarówno usunięcie urządzeń z listy zaufanych, jak również zweryfikowanie wszystkich operacji uwierzytelnienia przeprowadzonych z użyciem danego urządzenia. Sam dostęp do tego zasobu będzie również wymagał użycia wieloskładnikowego uwierzytelnienia.

Materiały: Szczegółowe materiały, w tym instrukcje związane z obsługą aplikacji *KDPW Group Authenticator*, zostały udostępnione na stronie internetowej KDPW pod adresem: <http://www.kdpw.pl/pl/MFA/Strony/default.aspx>.

Testy: Wymóg dwuskładnikowego uwierzytelniania w środowisku testowym został wprowadzony w maju 2022 r., wraz z aplikacją mobilną *KDPW Group Authenticator* oraz możliwością zarządzania

urządzeniami uwierzytelniającymi. Natomiast w dniu 12 września 2022 r. mechanizm dwuskładnikowego uwierzytelniania uruchomiony został w środowisku edukacyjnym.

Wdrożenie: Wprowadzanie wymogu podania drugiego składnika uwierzytelniania do wszystkich aplikacji w Portalu usług GK KDPW w ramach środowiska produkcyjnego – nastąpi w dniu **5 listopada 2022 r.**

6. Dostosowanie GK KDPW do systemu Target Services

W związku z dostosowaniem GK KDPW do systemu Target Services w systemach informatycznych KDPW wprowadzone zostały zmiany spełniające wymogi nowego systemu Target Services powstałego z konsolidacji systemu Target2 i systemu Target2-Securities. Obecnie, KDPW i KDPW_CCP, jak każdy uczestnik systemu Target 2 finalizują przygotowania do migracji na nową platformę rozliczeń płatności w EUR - Target Services.

Testy: Od marca 2022 r. prowadziliśmy z Państwa udziałem intensywne testy mające na celu weryfikację poprawności procesu rozrachunku w KDPW i KDPW_CCP dla waluty EUR.

Wdrożenie: W dniu **21 listopada 2022 r.** paneuropejski system międzybankowych rozliczeń w euro Target2 prowadzony przez Eurosystem zostanie zastąpiony usługą T2, która stanie się jednym z elementów pakietu Target Services.

7. Uruchomienie nowych stron www KDPW i KDPW_CCP

W Grupie kapitałowej KDPW prowadzone są prace nad nowymi stronami internetowymi KDPW i KDPW_CCP, które docelowo zintegrowane zostaną z Portalem usług - online.kdpw.pl oraz z Portalem danych - data.kdpw.pl. Na nowych stronach przewidujemy zmianę architektury informacyjnej, przy czym nadal za pośrednictwem stron www będziemy udostępniać Państwu opisy systemów, w tym dokumentację komunikatów systemowych (xml) własnych oraz listę wykorzystywanych komunikatów ISO wraz z odnośnikiem do odpowiedniej sekcji na portalu MyStandards.

Uprzejmie przypominamy, że dokumentacja komunikatów ISO15022 oraz ISO20022 stosowanych w komunikacji z Państwem w obszarach Corporate Actions, Settlement and Reconciliation oraz Clearing, udostępniana jest na platformie *MyStandards* przez GK KDPW od marca 2017 r., a podstawowy dostęp do platformy *MyStandards*, jest darmowy i wymaga jedynie standardowej rejestracji, typowej dla serwisów internetowych (system dostępny jest pod adresem: <http://mystandards.swift.com/>). Strona domowa Grupy KDPW na platformie MyStandards znajduje się pod adresem: https://www2.swift.com/mystandards/#/group/KDPW_Group.

Wdrożenie: Uruchomienie nowych stron internetowych KDPW i KDPW_CCP planowane jest od dnia **1 stycznia 2023 r.**

8. Modernizacja obsługi certyfikatów dostępowych w obszarze komunikacji A2A

Wzrost zagrożeń w obszarze bezpieczeństwa systemów informatycznych i jednocześnie zwiększanie liczby usług, jakie GK KDPW oferuje Państwu za pośrednictwem elektronicznych kanałów dostępu, zdecydowały o powołaniu w GK KDPW projektu, który ma na celu wprowadzenie zmian w obszarze wykorzystania certyfikatów elektronicznych w ramach komunikacji A2A. Zmiany te, to przede

wszystkim odejście od imiennego charakteru certyfikatów oraz ujednoczenie ich budowy (w szczególności wprowadzeniu jednolitych algorytmów kryptograficznych) i sposobu wykorzystania we wszystkich usługach GK KDPW. Proces wnioskowania o wydanie certyfikatu będzie realizowany w ramach Portalu usług - online.kdpw.pl, w oparciu o klucz prywatny generowany bezpośrednio przez wnioskującego.

Wdrożenie: Wprowadzanie zmian w obsłudze certyfikatów dostępowych w obszarze komunikacji A2A planowane jest w dwóch etapach: I etap - modernizacja w zakresie usług RT EMIR, RT SFTR i ARM planowana jest **w kwietniu 2023 r.**; II etap - modernizacja w zakresie usług KDPW i KDPW_CCP – **w kwietniu 2024 r.**

9. Dostosowanie systemów GK KDPW do nowego systemu transakcyjnego WATS

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obligatoryjne

Mając na uwadze wpływ zmian związanych z wdrożeniem nowego systemu transakcyjnego GPW na systemy, aplikacje oraz infrastrukturę IT, w Grupie Kapitałowej KDPW prowadzony jest projekt mający na celu dostosowanie systemów GK KDPW (głównie systemu kdpw_stream) do nowego systemu transakcyjnego WATS. Harmonogram prac projektowych po stronie GK KDPW jest zależny od harmonogramu projektu WATS.

Na obecnym etapie projektu zidentyfikowaliśmy potrzebę aktualizacji komunikatów ISO20022 z obszaru Securities Clearing (secl) polegającą na: dodaniu standardowej koperty komunikacyjnej KDPW stosowanej dla innych grup komunikatów, aktualizacji do obecnie obowiązującej wersji 03, możliwym poszerzeniu lub dostosowaniu zawartości informacyjnej do wymogów systemu WATS.

W przypadku pojawienia się kolejnych potrzeb dostosowawczych, będziemy informować Państwa w ramach odrębnej korespondencji.

Materiały: Szczegółowe materiały dot. zmian w komunikatach ISO20022 z obszaru Securities Clearing (secl) prześlemy Państwu **w lutym 2023 r.**

Testy: Podłączenie systemów GK KDPW do środowiska testowego GPW eUAT planujemy **na przełomie marca i kwietnia 2023 r.**, a podłączenie do środowiska GPW prePROD - **pod koniec czerwca 2023 r.** Nowe wersje komunikatów ISO20022 z obszaru Securities Clearing (secl) udostępniemy w środowisku testowym od **lipca 2023 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie nowych wersji komunikatów (secl) nastąpi łącznie z wdrożeniem nowego systemu WATS, tj. w **II kwartale 2024 r.**

10. Dostosowanie systemu Repozytorium Transakcji EMIR do zmian wynikających z EMIR REFIT oraz raportowania danych do RT KDPW przez KDPW_CCP

dostosowanie systemów informatycznych uczestników Repozytorium Transakcji EMIR – obligatoryjne

GK KDPW prowadzi projekt mający na celu dostosowanie systemu Repozytorium Transakcji EMIR do zmian wynikających z rozporządzenia EMIR REFIT. Chcąc umożliwić uczestnikom RT EMIR wywiązywanie się z obowiązków raportowych, a nadzorcom efektywny, niezakłócony dostęp do danych KDPW_TR, w ramach projektu planowane są: implementacja nowych schematów komunikatów xml w standardzie ISO 20022, wdrożenie nowych kontroli formalnych i merytorycznych, zmiana struktury

baz danych i migracji danych, zwiększenie wydajności systemu, zmiany w obsłudze procesów dostosowanie raportów dla nadzorców oraz zmiany w interfejsie uczestnika/użytkownika RT EMIR.

Materiały: Szczegółowe materiały dot. zmian w systemie Repozytorium Transakcji EMIR prześlemy Państwu w **kwietniu 2023 r.** Niemniej jednak, mając na uwadze złożoność zmian wynikających z rozporządzenia EMIR REFIT, w dniu 15 listopada 2022 r. zorganizujemy warsztat dot. planowanych zmian (szczegóły dot. warsztatu prześlemy odrębną korespondencją).

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z udziałem uczestników RT EMIR przewidujemy począwszy **od listopada 2023 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie zmian dostosowujących system Repozytorium Transakcji EMIR oraz KDPW_CCP do zmian wynikających z EMIR REFIT planowane jest w **kwietniu 2024 r.**

11. Przygotowanie usługi rozliczenia instrumentów OIS opartych na WIRON oraz konwersji WIBOR legacy portfolio

W związku z prowadzoną reformą wskaźników referencyjnych, zakładającą m.in. wprowadzenie nowego wskaźnika referencyjnego stopy procentowej WIRON zastępującego wskaźnik WIBOR, którego danymi wejściowymi są informacje reprezentujące transakcje ON (overnight), w KDPW_CCP powołany został projekt mający na celu dostosowanie systemów, procesów, procedur i regulacji dotyczących rozliczeń i zarządzania ryzykiem do obsługi nowego wskaźnika referencyjnego oraz konwersji portfela transakcji na nowe instrumenty.

Testy: Testy nowego rozwiązania przewidujemy począwszy **od stycznia 2024 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie (OIS) planowane jest w **II kwartale 2024 r.**, a konwersja portfeli w **IV kwartale 2024 r.**

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
Urząd Komisji Nadzoru Finansowego