ZMIANY SYSTEMOWE ZWIĄZANE Z WDROŻENIEM CYKLU ROZRACHUNKU T+1

SPIS TREŚCI

I ROZRACHUNEK W CZĘŚCIACH 2

II RAPORT ALLEGEMENT 2

III WPROWADZENIE OBOWIĄZKU POSIADANIA KODU BIC11 4

IV MIGRACJA / AKTUALIZACJA W ZAKRESIE KOMUNIKATÓW ROZRACHUNKOWYCH ZGODNYCH Z NORMĄ ISO20022 4

V ZMIANY W KOMUNIKATACH WŁASNYCH XML 5

VI ZMIANY W OBSZARZE OBSŁUGI ZDARZEŃ KORPORACYJNYCH 6

I Rozrachunek w częściach

Zostanie wprowadzona **obligatoryjność/domyślność stosowania rozrachunku w częściach**.

W przypadku operacji, dla których stosowany jest rozrachunek w częściach będą obowiązywać następujące zasady:

- Brak wypełnienia w instrukcji rozrachunku pola dot. zgody na rozrachunek w częściach oznacza ZGODĘ
- Wyłącznie wskazanie BRAKU ZGODY na rozrachunek w częściach w treści instrukcji rozrachunku będzie oznaczać niewykonywanie takiej operacji
- Możliwe będzie przekazywanie instrukcji technicznych zmieniających wartość dot. zgody na rozrachunek w częściach w odniesieniu do przesłanych wcześniej zleceń rozrachunku

Utrzymana zostanie obecna struktura komunikatu xml dot. konta podmiotowego – zatem będzie obowiązywać wersja acmt.rqa.001.03.

Zostanie utrzymana w bazie kont podmiotowych flaga informacji o zgodzie/braku zgody na rozrachunek w częściach, jednakże **przy wszystkich kontach podmiotowych** flaga ta zostanie ustawiona na wartość „zgoda". Czynność ta zostanie dokonana przez KDPW z dniem wdrożenia T+1, tj. 11.10.2027 r.

Od 11.10.2027 r. uczestnicy nie będą mogli z wykorzystaniem komunikatów systemowych dokonać zmiany tej wartości.

W przypadku przekazania do KDPW komunikatu xml acmt.rqa.001.03 dot. konta podmiotowego, jako niepoprawne zostanie potraktowane wskazanie wartości NPART w polu dedykowanym dla „zezwolenia na rozrachunek w częściach". Taki wniosek otwarcia konta podmiotowego zostanie odrzucony.
W przypadku każdego nowego konta podmiotowego otwieranego przez uczestnika zostanie do danego konta przypisana „zgoda" na rozrachunek w częściach, niezależnie od tego czy w komunikacie xml dot. otwarcia tego konta tak zgoda została wyrażona.

Przewidywany termin rozpoczęcia testów: kwiecień 2027 r.

Termin wdrożenia zmian: 11.10.2027 r.

II Raport allegement

KDPW wprowadzi mechanizm informowania uczestników KDPW o oczekującej na zestawienie instrukcji rozrachunku przekazanej przez kontrpartnera.

Informacja będzie przekazywana za pomocą nowego komunikatu systemowego. W ramach uzgodnień grupy S&R NMPG PL ustalono, że właściwym komunikatem implementowanym przez KDPW będzie komunikat zgodny ze standardem ISO20022: **sese.028.001.12**.

Tym samym nie jest przewidywane tworzenie rozwiązania opartego na własnych komunikatach xml.

Nowy typ komunikatu będzie dostępny poprzez dotychczasowe kanały telekomunikacyjne stosowane przez KDPW. Odbiór tego typu komunikatu nie będzie wymagał od uczestników deklaracji komunikacji za pomocą komunikatów ISO20022.

Komunikaty allegement będą poprzedzone nagłówkiem BAH (business application header) w wersji 2.0 (head.001.001.02), stosowanym w Swift SR2026. W zależności od kanału, do którego wysyłany jest komunikat, komunikaty allegement wraz z nagłówkiem BAH będą obudowane kopertą sytemu kdpw_stream lub kopertą wymaganą przez system Swift InterAct.

Przypominamy jednocześnie, że w 2027 r. zostanie udostępniona podstawowa funkcjonalność allegement w postaci przekazywania kontrpartnerowi komunikatu 'allegement notification' niezwłocznie po otrzymaniu przez KDPW instrukcji rozrachunku spełniającej wymagane warunki. Ewentualna rozbudowa procesu uwzględniająca takie elementy jak: odwoływanie powiadomienia allegement (sese.029), odpowiedź na otrzymany allegement (sese.040), czy wprowadzenie celowych opóźnień w przekazywaniu powiadomień allegement, jest przewidziana do ewentualnego wdrożenia w kolejnych latach, po wypracowaniu rozwiązań z rynkiem w ramach S&R NMPG PL.

Kluczowe zasady dot. raportu allegement:

1. Komunikat allegment będzie tworzony i przesyłany do agenta rozrachunku/strony rozrachunku będącego kontrpartnerem nadawcy instrukcji rozrachunku i dla kodu statusu oznaczającego instrukcję oczekującą na zestawienie (kod: NMAT/CMIS).
2. Komunikat allegement będzie tworzony każdorazowo w tych samych przypadkach, w których tworzony jest komunikat statusowy dla instrukcji niezestawionej z kodem statusu: NMAT/CMIS.
3. W toku konsultacji rynkowych w ramach S&R NMPG PL uzgodniono, że komunikaty sese.sts xml systemu kdpw_stream będą przekazywane nadal na dotychczasowych zasadach, a komunikaty allegement będą wysyłane do kontrpartnera dodatkowo w tym samym czasie.
4. W kanale wymiany danych ISO20022 zostanie przyjęta zasada zgodna z praktyką rynkową SMPG, oznaczająca przesyłanie komunikatów allegement zamiennie z komunikatem statusowym (komunikat statusowy przekazywany do wystawcy, a allegement do kontrpartnera). Taka zasada obowiązuje w działającym obecnie kanale wymiany danych rozrachunkowych ISO20022.
5. Komunikat allegement będzie tworzony zawsze na podstawie tych samych danych, co związany z nim komunikat statusowy.
6. Komunikat allegement może być wysyłany wielokrotnie, aż do momentu zestawienia się instrukcji. Przykładem potrzeby wielokrotnego przesyłania komunikatu statusowego i allegement, mimo braku zmiany kodu statusu i przyczyny instrukcji, jest zmiana instrukcji rozrachunku za pomocą instrukcji technicznej w zakresie Hold/Release lub zezwolenia na rozrachunek w częściach (RwC).
7. Uczestnik może zrezygnować z odbioru komunikatów allegement za pomocą dostępnych mechanizmów deklaracji odbioru wybranych typów komunikatów.
8. Jedyną strukturą komunikatu allegement w KDPW będzie: **sese.028.001.12** zgodna z ISO20022 w wersji zgodnej Swift SR2026.

Schemat komunikatu allegement (sese.028.001.12) jest dostępny są na platformie MyStandards, w ramach kolekcji znajdującej się pod następującym linkiem:

https://www2.swift.com/mystandards/#/mp/mx/_W4a6cJx8EfGWtbkYVBO5-Q/_5nPp8Jx8EfGWtbkYVBO5-Q!content

Przy tej okazji pragniemy przypomnieć, że Grupa KDPW udostępnia od 2017 r. dokumentację komunikatów ISO wykorzystywanych do komunikacji z kontrahentami na platformie MyStandards. Dostęp do MyStandards jest darmowy i nie wymaga posiadania licencji SWIFT. Wymagana jest jedynie wcześniejsza rejestracja na platformie.

Przewidywany termin rozpoczęcia testów: czerwiec 2027 r.

Termin wdrożenia zmian: lipiec 2027 r.

III Wprowadzenie obowiązku posiadania kodu BIC11

KDPW wprowadzi formalny wymóg w relacji do każdego uczestnika bezpośredniego KDPW w zakresie obowiązku posiadania i **wskazania odrębnego kodu BIC11 (zarejestrowanego w bazach SWIFT)** dla każdego kodu uczestnictwa bezpośredniego w KDPW.

Oznacza to, że każdemu obecnie funkcjonującemu kodowi instytucji nadanemu przez KDPW uczestnikowi bezpośredniemu zostanie przypisany unikalny kod BIC11.

Dotychczasowe 4-znakowe kody instytucji będą funkcjonować równolegle z przyporządkowanymi kodami BIC11. Nie są planowane zmiany wprowadzające wymóg stosowania BIC11 zamiast kodu uczestnika. Zmiana umożliwi w szczególności powszechne stosowanie kodów BIC11 w procesach rozrachunkowych (jednoznaczne wskazywanie uczestnika KDPW z wykorzystaniem kod BIC11). W szczególności możliwe będzie wskazywanie kontrahenta w instrukcji rozrachunku w postaci kod BIC11 zamiast 4-znakowego kodu nadanego przez KDPW.

Wprowadzenie ww. wymogu nie skutkuje zmianami w strukturach komunikatów xml – już obecnie jest dostępne pole dedykowane dla wskazania kodu BIC jako identyfikatorów stron rozrachunku, np. w polach: DeliveringPartiesAndAccount/DlvrgAgtDtls lub ReceivingPartiesAndAccount/RcvgAgtDtls.

Ze strony KDPW planujemy przygotowanie odpowiedniego formularza dla zgłaszania kodów BIC11 dla poszczególnych oznaczeń kodowych uczestników bezpośrednich KDPW. Zwracamy uwagę, że kody takie będą wymagane odpowiednio wcześniej na potrzeby przeprowadzenia testów w środowisku TST.

Przewidywany termin rozpoczęcia testów: czerwiec 2027 r.

Termin wdrożenia zmian: 11.10.2027 r.

IV Migracja / aktualizacja w zakresie komunikatów rozrachunkowych zgodnych z normą ISO20022

KDPW dokona aktualizacji komunikatów ISO20022 dotyczących obszaru rozrachunku, które będą mogły być wymieniane przez sieć SWIFT, a także za pomocą kolejek MQ oferowanych przez KDPW.

KDPW będzie obsługiwać następujące komunikaty ISO20022 zgodne ze Swift Standard Release 2026:

- sese.023.001.13 – Securities Settlement Transaction Instruction,
- sese.024.001.14 – Securities Settlement Transaction Status Advice,
- sese.025.001.13 – Securities Settlement Transaction Confirmation,
- semt.017.001.14 – Securities Transaction Posting Report,
- semt.002.001.12 - Securities Balance Custody Report,
- semt.013.001.07 - Intra Position Movement Instruction,
- sese.020.001.09 - Securities Transaction Cancellation Request,
- semt.021.001.09 - Securities Statement Query,
- sese.021.001.08 - Securities Transaction Status Query,
- sese.028.001.12 - Securities Settlement Transaction Allegement Notification,
- sese.030.001.10 - Securities Settlement Conditions Modification Request.

Wymiana komunikatów rozrachunkowych ISO20022 będzie dostępna w trzech kanałach:
a/ A2A – z wykorzystaniem istniejących obecnie kolejek MQ w usłudze csd;
b/ A2A SWIFT - w ramach zamkniętych grup CUG (closed user group);
c/ U2A – możliwość przesyłania plików xml zawierających instrukcje rozrachunku i instrukcje techniczne za pomocą aplikacji „Usługi CSD – uczestnik bezpośredni" udostępnianej przez KDPW.

Komunikaty będą poprzedzone nagłówkiem BAH (business application header) w wersji 2.0 (head.001.001.02), stosowanym w Swift SR2026.

Schematy ww. komunikatów dostępne na platformie MyStandards, w ramach kolekcji ‘KDPW_Settlement_MX_SR2026’ znajdującej się pod następującym linkiem:

https://www2.swift.com/mystandards/#/group/KDPW_Group/CSD_of_Poland__KDPW__subgroup_

Przewidywany termin rozpoczęcia testów: lipiec 2027 r.

Termin wdrożenia zmian: wrzesień 2027 r.

V Zmiany w komunikatach własnych xml

1. Zmiany związane z przyszłym wdrożeniem usługi partial release – przypominamy, że usługa ta zostanie wdrożona w 2028 r.

1) Instrukcja techniczna **sese.tec -** dodanie pola **Qty** (Quantity of Financial Instrument) umożliwiającego wskazanie wolumenu aktywów zwalnianych do rozrachunku.
2) Status instrukcji rozrachunku **sese.sts -** dodanie pola **PrtlyRlsdQty** (Partially Released Quantity), służącego do przekazania stronom rozrachunku informacji o zwalnianej części aktywów.

Do czasu wprowadzenia funkcjonalności partial release zawartość nowych pól nie będzie obsługiwana. Jeżeli pole **Qty** zostanie wypełnione przez wystawcę komunikatu sese.tec, to komunikat nie będzie odrzucany, ale wartość pola nie będzie wczytywana ani zapamiętywana w systemie.

2. Zmiany porządkowe w strukturze komunikatów rozrachunkowych

1) Usunięcie pól służących do wskazywania dwuznakowych kodów operacji **KDPWSttlmTxTp**, kodów rynku **KDPWPlcOfTrad** i trybów obrotu **KDPWTradMode.** Obecnie obsługiwane są tylko czteroznakowe odpowiedniki powyższych pól.
2) Usunięcie pól charakterystycznych dla transakcji repo poprzez usunięcie sekcji: **RpDtls.**
3) Usunięcie opcjonalnych pól związanych z market claims i transformacji: **OptOutTrfCd**, **ExCumCd.**

Zmiany dotyczą struktur komunikatów: **sese.ins i sese.sts**.

3. Wydłużenie długości identyfikatora rachunku pieniężnego

Długość pola **CshAcct** zostanie wydłużona z 28 do **34** znaków.
Obecna długość jest wystarczająca dla krajowych rachunków zgodnych z NRB, ale nie jest zgodna z maksymalną długością identyfikatora rachunku wg standardu IBAN (ISO 13616).
Zmiany dotyczą struktur komunikatów: **sese.ins i sese.sts**.

4. Zmiana związana z rozwojem obsługi zdarzeń korporacyjnych

W strukturze komunikatu **sese.sts** zostanie dodane opcjonalne pole: **SttlmTxCond.**
Zasady wypełniania tego pola zostaną określone w odrębnym projekcie dot. dostosowania obsługi operacji podziału i scalenia papierów wartościowych do standardów międzynarodowych.

5. Powyższe zmiany będą powodować zmian wersji komunikatów:

1) sese.tec.001.**02** –> sese.tec.001.**03**
2) sese.sts.001.**05** –> sese.sts.001.**06**
3) sese.ins.001.**03** -> sese.ins.001.**04**

Schematy ww. komunikatów dostępne stronie internetowej KDPW znajdującej się pod następującym linkiem:

https://www.kdpw.pl/pl/zmiany-komunikatow-systemowych.html

Przewidywany termin rozpoczęcia testów: sierpień 2027 r.

Termin wdrożenia zmian: 11.10.2027 r.

VI Zmiany w obszarze obsługi zdarzeń korporacyjnych

Dostosowania w systemie KDPW obejmą następujące obszary:

- zmiana zasad wyznaczania dnia ex-date
- wprowadzenie w notyfikacjach udostępnianych przez KDPW informacji o tzw. datach kluczowych, w szczególności „last trading date"

Powyższe modyfikacje nie powodują zmiany struktur komunikatów systemowych wykorzystywanych w systemie kdpw_stream dla obsługi zdarzeń korporacyjnych, z zastrzeżeniem zmiany schematu komunikatu seev.031 dla zdarzeń SPLF i SPLR, polegającej na dodaniu pola LastTradgDt, wynikającej z prowadzonego równolegle projektu „Split i reverse-split zgodnie ze standardami międzynarodowymi".

Niezależnie od powyższego informujemy, że w ramach dostosowań/rozwoju usług w zakresie procesów dot. zdarzeń korporacyjnych zostanie wzbogacony komunikat **sese.sts** (status instrukcji rozrachunku) w zakresie przekazywania informacji potwierdzającej realizację transformacji, dane wskazywane w polu **SttlmTxCond**

Jest to zmiana, o której mowa powyżej w sekcji „Zmiany w komunikatach własnych xml".

W załączeniu przekazujemy Państwu materiał szczegółowy zawierający opis zmian związanych ze wzbogaceniem informacji przekazywanych przez KDPW w ramach obsługi zdarzeń korporacyjnych. Pragniemy przy tym podkreślić, że wykorzystanie tych danych przez uczestników KDPW jest z naszego punktu widzenia fakultatywne, z zastrzeżeniem zmiany dotyczącej zastosowania „last trading day" jako daty istotnej w procesie walidacji instrukcji rozrachunkowych, wynikającej z prowadzonego równolegle projektu „Split i reverse-split zgodnie ze standardami międzynarodowymi". Ponadto zwracamy uwagę na zmianę metodologii wyznaczania Market Deadline dla zdarzeń BIDS i EXRI.

Przewidywany termin rozpoczęcia testów: lipiec 2027 r.

Termin wdrożenia zmian: 11.10.2027 r.