

Załącznik 1

Analiza wykorzystania znaczników DBIT/CRDT i RECE/DELI w komunikatach KDPW związanych z rozrachunkiem

| DATA AKTUALIZACJI | WERSJA | OPIS |
|-------------------|--------|-------------------|
| 04.2023 | 1.0 | Wersja początkowa |

SPIS TREŚCI

| | | |
|-------|--|---|
| I | WSTĘP..... | 2 |
| II | ZNACZNIK DBIT/CRDT | 2 |
| II.1. | KOMUNIKAT STATUSU INSTRUKCJI ROZRACHUNKU SESE.STS..... | 2 |
| II.2. | ZESTAWIENIE KAR PIENIĘŻNYCH SEMT.044..... | 3 |
| III | ZNACZNIK RECE/DELI | 4 |
| IV | ZMIANY W KOMUNIKATACH ISO15022 I ISO20022 | 5 |

I Wstęp

Dokument opisuje wykorzystanie znaczników DBIT/CRDT oraz RECE/DELI w komunikatach systemu kdpw_stream oraz wpływ planowanych zmian na zasady ich stosowania.

II Znacznik DBIT/CRDT

Znacznik DBIT/CRDT wykorzystywany jest do oznaczenia kierunku przepływów pieniężnych w komunikatach rozrachunkowych.

Znacznik ten jest stosowany m.in. w komunikatach:

- sese.sts.001.05 – status instrukcji rozrachunku;
- semt.044.001.01 – zestawienie kar pieniężnych.

Znacznik DBIT/CRDT jest również stosowany w innych komunikatach, ale dla pozostałych przypadków wykorzystania nie zidentyfikowano potrzeby zmian.

II.1. Komunikat statusu instrukcji rozrachunku sese.sts.001.05

Przykład – Uczestnik ABCD sprzedał uczestnikowi WXYZ papiery wartościowe o wartości 123.000 zł. Uczestnik ABCD przesłał do KDPW instrukcję DP (dostawa płatna), a uczestnik WXYZ instrukcję PP (przyjęcie płatne). Zwrotne komunikaty statusowe sese.sts.001.05 będą w takim przypadku zawierać .in.. następujące dane, w zależności od adresata komunikatu:

Stan obecny, komunikat xml kdpw_stream sese.sts.001.05:

| ABCD - debetowany w papierach | WXYZ – kredytowany w papierach | Uwagi |
|---|--|--|
| <pre><InstrTp>DP</InstrTp> ... <SttImAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd> </SttImAmt></pre> | <pre><InstrTp>PP</InstrTp> .. <SttImAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd> </SttImAmt></pre> | Wartość CRDT przekazywana obu stronom transakcji |

Stan po planowanej zmianie, komunikat xml kdpw_stream sese.sts.001.05:

| ABCD – debetowany w papierach | WXYZ – kredytowany w papierach | Uwagi |
|---|---|--|
| <pre><InstrTp>DP</InstrTp> ... <SttImAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd> </SttImAmt></pre> | <pre><InstrTp>PP</InstrTp> ... <SttImAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </SttImAmt></pre> | Instytucja kredytowana w papierach otrzyma wartość DBIT odzwierciedlającą rzeczywisty kierunek przepływu pieniężnego |

II.2. Zestawienie kar pieniężnych semt.044.001.01

Znacznik DBIT/CDIT występuje w komunikacie sesmt.044.001.01 w kilku miejscach:

- dla wartości wyliczonych kar, p..:

```
<CmptdAmt>
  <Amt Cc="P"N">45</Amt>
  <CdtDbt>DBIT</CdtDbt>
</CmptdAmt>
```

Kierunek naliczonych kar jest obecnie przekazywany poprawnie i nie wymaga zmian.

- w sekcji ze szczegółami transakcji źródłowej:

```
<PstngAmt>
  <Amt Cc="P"N">900000</Amt>
  <CdtDbt>CRDT</CdtDbt>
</PstngAmt>
```

Znacznik CRDT/DBIT przekazywany w tej sekcji podlega tym samym regułom, co komunikat statusowy sese.sts, w związku z powyższym wymaga analogicznych zmian.

Stan obecny, komunikat semt.044.001.01:

| ABCD - debetowany w papierach | WXYZ – kredytowany w papierach | Uwagi |
|--|---|--|
| <pre><SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp> <Pmt>APMT</Pmt> ... <SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd> </SttlmAmt></pre> | <pre><SctiesMvmntTp>RECE</SctiesMvmntTp> <Pmt>APMT</Pmt> .. <SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd> </SttlmAmt></pre> | Wartość CRDT przekazywana obu stronom transakcji |

Stan po planowanej zmianie, komunikat semt.044:

| ABCD – debetowany w papierach | WXYZ – kredytowany w papierach | Uwagi |
|--|--|--|
| <pre><SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp> <Pmt>APMT</Pmt> ... <SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd> </SttlmAmt></pre> | <pre><SctiesMvmntTp>RECE</SctiesMvmntTp> <Pmt>APMT</Pmt> ... <SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">123000</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </SttlmAmt></pre> | Instytucja kredytowana w papierach otrzyma wartość DBIT odzwierciedlającą rzeczywisty kierunek przepływu pieniężnego |

III Znacznik RECE/DELI

Znacznik RECE/DELI wykorzystywany jest do oznaczenia kierunku przepływów papierów wartościowych w komunikatach rozrachunkowych ISO20022.

Znacznik ten nie jest bezpośrednio wykorzystywany w podstawowych komunikatach xml kdpw_stream. Funkcje tego znacznika spełnia pole typ instrukcji (*InstTp*), o wartościach:

- PP – przyjęcie płatne (RECE)
- PN – przyjęcie niepłatne (RECE)
- DP – dostawa płatna (DELI)
- DN – dostawa niepłatna (DELI)
- ZP – instrukcja zestawiona/ instrukcja z rynku płatna (dostawa i przyjęcie)
- ZN – instrukcja zestawiona/ instrukcja z rynku niepłatna (dostawa i przyjęcie)
- ZO - instrukcja zestawiona z odwróconym kierunkiem płatności (dostawa i przyjęcie)

KDPW stosuje znacznik RECE/DELI w zestawieniu kar pieniężnych semt.044 w sekcji opisującej szczegóły transakcji podlegającej karze.

Znacznik ten jest obecnie prawidłowo przypisywany stronom transakcji dla instrukcji typu: PP, PN, DP, DN.

Dla typów instrukcji ZP, ZN, ZO, dla których nie istnieją źródłowe instrukcje składowe, obecnie stosowany jest wybrany arbitralnie przez KDPW znacznik DELI przekazywany obu stronom transakcji. Proponowana zmiana zapewni dodatkowe badanie kierunku przepływu papierów dla każdego adresata komunikatu.

Stan obecny, komunikat semt.044.001.01:

Typ instrukcji źródłowej **DP, DN, PP, PN**:

| ABCD - debetowany w papierach | WXYZ – kredytowany w papierach | Uwagi |
|-------------------------------------|-------------------------------------|------------------|
| <SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp> | <SctiesMvmntTp>RECE</SctiesMvmntTp> | Poprawna wartość |

Typ instrukcji źródłowej **ZP, ZN, ZO**:

| ABCD - debetowany w papierach | WXYZ – kredytowany w papierach | Uwagi |
|-------------------------------------|-------------------------------------|--|
| <SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp> | <SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp> | Wartość DELI przekazywana obu stronom transakcji |

Stan po planowanej zmianie, komunikat semt.044.001.01:

Typ instrukcji źródłowej **DP, DN, PP, PN, ZP, ZN, ZO**:

| ABCD - debetowany w papierach | WXYZ – kredytowany w papierach | Uwagi |
|-------------------------------------|-------------------------------------|-------|
| <SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp> | <SctiesMvmntTp>RECE</SctiesMvmntTp> | |

IV Zmiany w komunikatach ISO15022 i ISO20022

Analogiczne zasady stosowania znaczników CRDT/DBIT oraz RECE/DELI zostaną zastosowane również w interfejsach komunikacyjnych ISO15022 i ISO2022 wykorzystywanych w KDPW.