

Załącznik 2

Zmiany w systemie rozrachunku

DATA AKTUALIZACJI	WERSJA	OPIS
18.04.2023	1.0	Wersja początkowa

SPIS TREŚCI

I	WSTĘP.....	2
II	HOLD RELEASE DLA TRANSFERÓW MIĘDZYSYSTEMOWYCH.....	2
II.1.	ZAŁOŻENIA DLA NOWEJ USŁUGI.....	2
II.2.	WARUNKI UMOŻLIWIAJĄCE WSTRZYMANIE ROZRACHUNKU.....	2
II.3.	ZWALNIANIE INSTRUKCJI DO ROZRACHUNKU	3
III	ZMIANY SYSTEMU ROZRACHUNKU MB->RTGS ORAZ RTGS->MB	3
III.1.	WARUNKI UMOŻLIWIAJĄCE ZMIANĘ SYSTEMU ROZRACHUNKU.....	3
III.2.	OBSŁUGA INSTRUKCJI ZMIANY SYSTEMU ROZRACHUNKU	4
IV	MODYFIKACJA W ZAKRESIE OKREŚLANIA MOMENTU NALICZANIA KAR PIENIĘŻNYCH CSDR (TZW. CUT-OFF DLA KAR)	4
IV.1.	SKUTKI PRZENIESIENIA INSTRUKCJI POMIĘDZY SYSTEMAMI ROZRACHUNKU	4

I Wstęp

Dokument opisuje zaplanowane na jesienne okno wdrożeniowe (18-19 listopada 2023 r.) zmiany związane z rozrachunkiem papierów wartościowych.

W materiale zawarto odniesienia do: mechanizmu hold-release dla transferów międzysystemowych, możliwości zmiany systemu rozrachunku (sesyjny-RTGS) MB->RTGS oraz RTGS->MB, a także modyfikację w zakresie określania momentu naliczania kar pieniężnych CSDR (tzw. cut-off dla kar) będącej konsekwencją wprowadzenia możliwości zmiany systemu rozrachunku.

II Hold-release dla transferów międzysystemowych

Na obecnym etapie zakładamy wdrożenie uproszczonego modelu hold-release dla transferów międzysystemowych, który będzie umożliwiał przekazywanie do systemu kdpw_stream instrukcji w statusie „HOLD” bez dalszego jej procesowania, a w szczególności wysyłania do zagranicznego depozytu w trybie wstrzymanego rozrachunku.

II.1. Założenia dla nowej usługi

Wstrzymywaniu rozrachunku podlegać będą instrukcje rozrachunku (sese.ins.001.03) z kodami operacji:

- TRAD lub MKDW dla typu instrukcji DN
- TRAD lub MKUP dla typu instrukcji PN

II.2. Warunki umożliwiające wstrzymanie rozrachunku

1. Aby możliwe było wstrzymanie rozrachunku niezbędne będzie przesłanie instrukcji rozrachunku (sese.ins.001.03) sformatowanej zgodnie z dotychczas stosowanymi wymogami dla transferów międzysystemowych, z tą różnicą, że dotychczas stosowany **atrybut „NEWM”** w polu **FuncOfMsg** należy zastąpić atrybutem **„PREA”**.

Wskutek powyższego nastąpi wstrzymanie rozrachunku „od początku życia instrukcji”.

Instrukcja transferu przesłana w tym trybie otrzyma zawsze:

- **kod statusu i przyczyny:** StsCd: „PEND”, RsnTp: „PREA” oznaczający „HOLD” wystawcy,
- atrybut „Y” w polu HldInd.

Ponadto, jak wspomniano powyżej, instrukcja dostarczona w statusie „HOLD” **nie zostanie wysłana do zagranicznego CSD** oraz w przypadku, gdy będzie to instrukcja na dostarczenie papierów (typ instrukcji **DN**) na tym etapie **nie nastąpi zmiana statusu aktywów z „AVAI” na „BLWR”**.

2. Nie będzie możliwe początkowe przesłanie instrukcji rozrachunku (sese.ins.001.03) z atrybutem **„NEWM”** wskazującym na zezwolenie na rozrachunek, a następnie przesłanie instrukcji technicznej (sese.tec.001.02) wstrzymującej rozrachunek, z **kodem operacji „SETT”** oraz **typem operacji „NPRE”**.

Wynika to z faktu, że przesłanie instrukcji z atrybutem „NEWM” będzie skutkowało wysłaniem odpowiedniej instrukcji do zagranicznego depozytu, stąd też nie będzie już dopuszczalna późniejsza zmiana statusu na „HOLD” dla tej instrukcji w kdpw_stream.

II.3. Zwalnianie instrukcji do rozrachunku

1. Zwalnianie instrukcji do rozrachunku następować będzie poprzez dostarczenie przez wystawcę instrukcji pierwotnej, instrukcji technicznej (sese.tec.001.02) z kodem operacji „SETT” oraz typem operacji „YPRE”, powiązanej z pierwotną instrukcją transferu międzysystemowego.
2. Do uczestnika wystawiającego dyspozycję zwolnienia instrukcji do rozrachunku będzie wysyłana:
 - instrukcja techniczna (sese.stt.001.01) potwierdzająca przetworzenie zlecenia ze statusem „PACK”,
 - instrukcja statusowa (sese.sts.001.05) ze statusem pierwotnej instrukcji, który zmieni się z „PREA” na „PEND” (RsnTp: „NCON”), pole HldInd natomiast zostanie wypełnione wartością „N”.

Zwolnienie instrukcji do rozrachunku z typem instrukcji DN będzie dodatkowo skutkowało generowaniem blokady papierów wartościowych instrukcją semt.smt.001.04 i zmianą statusu aktywów z „AVAI” na „BLWR”.

Po uwolnieniu instrukcji do rozrachunku i jej przeprosowaniu w kdpw_stream nastąpi wysłanie właściwej instrukcji transferu międzysystemowego do zagranicznego CSD na zasadach stosowanych obecnie.

III Zmiany systemu rozrachunku (sesyjny-RTGS): MB->RTGS oraz RTGS->MB

Wychodząc naprzeciw Państwa zgłoszeniom, a także w celu zwiększenia wolumenu instrukcji podlegających rozrachunkowi, wprowadzona zostanie funkcjonalność umożliwiająca **zmianę systemu rozrachunku** nie tylko dla instrukcji niezestawionych, jak jest to obecnie, ale także **dla instrukcji zestawionych**.

III.1. Warunki umożliwiające zmianę systemu rozrachunku

Aby dokonać przekierowania instrukcji do innego systemu muszą być spełnione następujące warunki:

1. Instrukcja może podlegać rozrachunkowi zgodnie z Harmonogramem dnia księgowego w danym systemie (w praktyce musi być dopuszczalna do rozrachunku w obu systemach),
2. obie strony operacji przekażą **zgodne zlecenia** (instrukcje techniczne sese.tec) ze zmienionym parametrem,
3. **dostarczenie i zestawienie** instrukcji zmiany systemu sese.tec.001.02 nastąpi **przed**:
 - maksymalnym możliwym terminem rozrachunku instrukcji, której dotyczy zmiana w danym systemie,
 - dyspozycją anulowania rozrachunku

4. instrukcja techniczna wskazywać będzie odpowiednio zmianę dla „**kodu operacji**” RTGS w polu „**typ operacji**”:
- **YRTG** - skierowanie wskazanej instrukcji rozrachunku do systemu RTGS
 - **NRTG** - skierowanie wskazanej instrukcji rozrachunku do systemu wielosecyjnego.

III.2. Obsługa instrukcji zmiany systemu rozrachunku

Po otrzymaniu zgodnych instrukcji technicznych zmiana systemu dla danej instrukcji nastąpi **w trybie on-line**, a instrukcja z nowo określonym parametrem, zostanie skierowana do właściwego systemu zgodnie z Harmonogramem dnia księgowego.

Tak jak ma to miejsce obecnie, po dokonaniu zmiany systemu rozrachunku zostanie do Państwa wysłany komunikat o obsłudze komunikatu sese.tec.001.02.

Jednocześnie uprzejmie informujemy, że zarówno komunikat sese.tec.001.02, jak i oznaczenia dotyczące zmiany systemu rozrachunku są już obecnie wykorzystywane w komunikacji z KDPW, dlatego nie ma konieczności wprowadzania zmian w tym komunikacie systemowym.

IV Modyfikacja w zakresie określania momentu naliczania kar pieniężnych CSDR (tzw. cut-off dla kar)

W wyniku wprowadzenia zmian opisanych powyżej, a odnoszących się do zmiany systemu rozrachunku w terminach określonych Harmonogramem dnia księgowego, **na nowo zostanie określony moment naliczenia kar pieniężnych typu SEFP (settlement fail penalty)**, czyli tzw. **cut-off** dla instrukcji podlegających zmianie.

Dla przypomnienia określenie momentu czasowego, w którym jest identyfikowana ww. kara jest następujące dla poszczególnych systemów:

- systemu sesyjnego (MB): koniec danej sesji rozrachunkowej
- RTGS: koniec możliwości rozrachunku danego rodzaju operacji.

IV.1. Skutki przeniesienia instrukcji pomiędzy systemami rozrachunku

W związku z przenoszeniem instrukcji pomiędzy systemami skorygowaniu podlegać będzie moment identyfikacji instrukcji służący do naliczenia kary, w następujący sposób:

- **MB -> RTGS**
po cut-off sesji rozrachunkowej, a przed cut-off w RTGS dla danej operacji
instrukcje:
 - rozrachowane w danym dniu – brak naliczenia kary SEFP
 - nierozrachowane w danym dniu – naliczenie kary SEFP po zakończeniu możliwości rozrachunku danej operacji w RTGS
- **RTGS -> MB**
po cut-off w RTGS, a przed cut-off w MB dla danej operacji
instrukcje:
 - rozrachowane w danym dniu – brak naliczenia kary SEFP

- nierozrachowane w danym dniu – naliczenie kary SEFP po zakończeniu możliwości rozrachunku danej operacji na sesji rozrachunkowej

Przy wycofywaniu zmienionej instrukcji z rozrachunku, cut-off dla naliczenia kary SEFP będzie taki jak dla wskazanego końcowo systemu rozrachunku.