

DO /ZW/679/2023

Warszawa, 21 kwietnia 2023 r.

Uczestnicy KDPW

**dot.: zmian w systemach informatycznych KDPW zaplanowanych na JESIENNE OKNO
WDROŻENIOWE_18-19 listopada 2023 r. w funkcjonalnościach procesu rozrachunku**

Szanowni Państwo,

W nawiązaniu do pisma SCP/ZW/8/2022 z dn. 4 października 2022 r. dotyczącego zmian w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP zaplanowanych na 2023 r. dziękujemy za przeprowadzone w ramach grupy S&R NMPG PL konsultacje odnoszące się do planowanych zmian w zakresie rozrachunku.

W wyniku naszych rozmów zdecydowaliśmy, że w jesiennym oknie wdrożeniowym wprowadzone zostaną następujące zmiany:

- zmiany dot. znaczników **kierunku przepływu** papierów wartościowych oraz środków pieniężnych w instrukcjach rozrachunku
- mechanizm **hold release** dla transferów **międzysystemowych**
- możliwość **zmiany** systemu rozrachunku (sesyjny-RTGS): **MB->RTGS; RTGS->MB**, w zakresie zestawionych zleceń rozrachunku
- modyfikacja w zakresie określania **momentu naliczania kar pieniężnych CSDR** (tzw. cut-off dla kar) będącej konsekwencją wprowadzenia możliwości zmiany systemu rozrachunku.

Uwzględniając Państwa stanowisko co do pracochłonności nowej funkcjonalności, na obecnym etapie **nie planujemy wdrożenia usługi partial release**.

Niemniej jednak chcielibyśmy zaznaczyć, że proponowane rozwiązanie optymalizuje wolumeny rozrachunku i mogłoby wspierać procesy rozrachunku transakcji kierowanych do systemu depozytowego przez uczestników KDPW, w tym w likwidacji zawieszonych, w związku z tym nie wykluczamy ponownego rozpatrzenia proponowanych zmian w przyszłych latach.

Testy z udziałem Uczestników KDPW w zakresie planowanych funkcjonalności przewidujemy rozpocząć **od 18 września 2023 r.**

Szczegóły dotyczące poszczególnych funkcjonalności znajdują Państwo w załącznikach do niniejszej korespondencji.

Z poważaniem

Krzysztof Ołdak
Dyrektor Działu Operacyjnego

Załączniki:

1. Analiza wykorzystania znaczników DBIT/CRDT i RECE/DELI w komunikatach KDPW związanych z rozrachunkiem
2. Opis zmian w systemie rozrachunku

Do wiadomości:

Izba Domów Maklerskich
Rada Banków Depozytariuszy przy ZBP