

Operacje realizowane w Systemie Obsługi Komunikatów SWIFT

Zakres realizowanych operacji z obszaru rozliczeń i rozrachunku (Settlement & Reconciliation) za pomocą komunikatów SWIFT (zgodnych z normą ISO15022) znajduje się poniżej.

1. Operacje realizowane bez ograniczeń

- Przyjmowanie i zestawianie instrukcji rozliczeniowych, w tym:
 - instrukcji wstępnych i ostatecznych,
 - instrukcji bez rozliczenia pieniężnego – komunikaty MT 540 i MT542 (np. zasilenie rachunku, transfer portfela, korekta błędów, transfery transgraniczne),
 - instrukcji z rozliczeniem pieniężnym – komunikaty MT 541 i MT543 (transakcje, przelewy posttransakcyjne).
- Przekazywanie potwierdzenia dokonania rozrachunku operacji przesłanych instrukcji rozliczeniowych - komunikaty MT544 – MT547. W przypadku gdy komunikaty te odnoszą się do instrukcji z giełdy, w referencji typu RELA będzie przekazywana referencja nadana przez giełdę.
- Akceptacja instrukcji.

2. Operacje realizowane w ograniczonym zakresie

- Przyjmowanie instrukcji rozliczeniowych z transakcjami złożonymi deklarowanymi jednostronnie z powiązaniem typu WITH (w rozumieniu kdpw_stream). W komunikatach ISO15022 konieczne będzie przesłanie linku typu POOL.
- Przekazywanie potwierdzenia dokonania rozrachunku operacji przesłanych instrukcji rozliczeniowych - komunikaty MT544 – MT547. W przypadku gdy komunikaty te odnoszą się do instrukcji z giełdy, w referencji typu RELA będzie przekazywana referencja nadana przez giełdę.
- Przekazywanie statusu instrukcji (komunikat MT548) dla instrukcji o podanym identyfikatorze lub dla wszystkich instrukcji dla konta podmiotowego o podanym identyfikatorze.
- Przekazywanie stanów kont ewidencyjnych dla konta podmiotowego o podanym identyfikatorze.
- Przekazywanie wyciągu operacji – komunikat MT536 dla konta podmiotowego o podanym identyfikatorze. W komunikacie tym sposób raportowania dla kont jednostatusowych odbywać się będzie w ten sam sposób jak dla kont wielostatusowych - zestawienie subkont.

- W komunikatach MT535 i MT536 odpowiednikiem stanu konta ewidencyjnego (identyfikowanego przez identyfikator konta podmiotowego i status aktywów) będzie subkonto w terminologii SWIFT.
- Przyjmowanie zapytania o wyciąg lub zestawienie stanów posiadania będzie możliwe tylko na poziomie konta podmiotowego (poziom konta ewidencyjnego nie będzie dostępny w zapytaniu).
- Usuwanie instrukcji rozliczeniowych – brak sygnalizacji błędu dla instrukcji technicznej.

3. Ograniczenia w komunikatach ISO15022 odnośnie zakresu informacyjnego lub praktyk SMPG

- Brak listy otwartych pożyczek.
- Zestawienie stanów posiadania będzie tylko w typie COMP (czyli pełny, nie przyrostowy).
- W wyciągu MT536 będą raportowane wszystkie ruchy na kontach pod kodem SETT.
- Brak obsługi MT538, który powinien istnieć w korespondencji do MT524; wszystkie zapisy będą w MT536.
- Referencja dla transakcji repo (RpDtIs/RpRef) będzie przekazywana w komunikatach ISO15022 poprzez pole Deal Reference.
- Nie będzie obsługiwane Repo collateral (typ repo R3).
- W komunikacie MT548 (status instrukcji) będzie stosowana tylko jedna wartość qualifier:
 - SETT dla statusów z procesów kontroli merytorycznej, matchingu i rozliczenia; oraz jedna wartość qualifier'a dla podania przyczyny.
 - PEND dla Reason Code.

4. Operacje realizowane z koniecznością użycia kodów DSS (Data Source Schema) KDPW

- Przyjmowanie instrukcji zmiany statusów aktywów (DSS: kody statusów aktywów) – instrukcje zmiany statusów aktywów mogą być wykorzystywane m.in. do obsługi zastawów, wykonywania warrantów i certyfikatów, udostępniania papierów do pożyczania, wnoszenia zabezpieczeń do Funduszu Rozliczeniowego, obsługi niektórych operacji na papierach. W projektowanym rozwiązaniu przewiduje się zachowanie kodów statusów aktywów stosowanych w kdpw_stream.
- Przykład: określenie docelowego statusu aktywów 'BLOK' w instrukcji zmiany statusów aktywów MT524 będzie miało postać: :93A::TOBA/KDPW/BLOK.
- Informowanie o statusie instrukcji rozliczeniowej (DSS: status instrukcji i kod przyczyny). W projektowanym rozwiązaniu przewiduje się zachowanie kodów statusów i kodów przyczyn stosowanych w kdpw_stream.
- Przykład: Informacja o błędzie związanym z nieznanym kodem waluty

:16R:STAT

:25D::SETT/KDPW/PENE

:16R:REAS

:24B::PEND/KDPW/R005

:16S:STAT

- Mechanizm akceptacji instrukcji.

Akceptacja instrukcji rozliczeniowych będzie realizowana poprzez instrukcje techniczne, których odpowiednikiem w standardzie ISO15022 jest komunikat MT530. Operacjom związanym z procesem akceptacji zostaną przypisane następujące kody:

- YACP – akceptacja instrukcji
- DACP – odmowa akceptacji
- CACP – żądanie usunięcia poprzedniego komunikatu

Przykład: Informacja o zaakceptowaniu instrukcji rozliczeniowej w komunikacie MT530 będzie miała postać:

- :22F::PROC/KDPW/YACP

- Obsługa nietypowych kodów rynku, w tym przyjmowanie przelewów posttransakcyjnych dla kodu rynku XP (rynek powiązany z regulowanym).

W typowych przypadkach kod rynku będzie można podawać za pomocą standardowych kodów MIC, np. dla instrukcji związanej z transakcją zawartą na GPW należy wypełnić pole: :94B::TRAD//XWAR. W przypadkach nietypowych, takich jak wspomniany kod rynku XP, należy skorzystać z kodu KDPW, np: :94B::TRAD/KDPW/XPXX (dwuznakowe kody KDPW muszą być dopełniane znakami XX, w celu uzyskania zgodności z 4-znakową długością pola wymaganą przez SWIFT).

- Obsługa nietypowych trybów obrotu (DSS: kod trybu obrotu).

Tryb obrotu jest polem opcjonalnym i większości przypadków nie musi być wypełniany. W szczególnych przypadkach kod trybu obrotu należy podać w polu: :22F::TTCO.

Przykład: W instrukcji związanej z przydziałem praw do papierów wartościowych nowej emisji (tryb obrotu: PS) powinno zostać wypełnione pole:22F::TTCO/KDPW/PSXX. (dwuznakowe kody KDPW muszą być dopełniane znakami XX, w celu uzyskania zgodności z 4-znakową długością pola wymaganą przez SWIFT).

- Obsługa nietypowych kodów operacji (DSS: kod operacji rozliczeniowej).

Typowe kody operacji rozliczeniowych będzie można podawać w postaci standardowych oznaczeń SWIFT'owych, np. transakcja będzie oznaczana kodem: :22F::SETR/TRAD. Dla kodów operacji, dla których nie ma odpowiedników w standardzie SWIFT należy posłużyć się kodem KDPW, np. rozliczenie wykonania warrantów zostanie oznaczone jako: :22F::SETR/KDPW/WWXX. (dwuznakowe kody KDPW muszą być dopełniane znakami XX, w celu uzyskania zgodności z 4-znakową długością pola wymaganą przez SWIFT).