

CCP/ZW/471/2014

Warszawa, 23 maja 2014 r.

**Uczestnicy KDPW\_CCP**  
**Uczestnicy KDPW**

Szanowni Państwo,

w nawiązaniu do wcześniejszej korespondencji uprzejmie informujemy, iż na wniosek Uczestników KDPW i KDPW\_CCP, ulegnie przesunięciu termin wdrożenia nowych funkcjonalności dotyczących w szczególności rozrachunku w częściach (KDPW) i nettingu w papierach wartościowych (KDPW\_CCP).

Ze względu na szereg procesów warunkowanych po stronie Uczestników uruchomieniem nowych funkcjonalności, w porozumieniu z Izbą Domów Maklerskich oraz Radą Banków Depozytariuszy, wdrożenie zostało zaplanowane w dwóch etapach. W terminie 28-29 czerwca (weekend) br. nastąpi wdrożenie nowej wersji oprogramowania systemu kdpw\_stream z nieaktywnymi nowymi usługami: automatyczny rozrachunek w częściach, netting w papierach wartościowych dla rozliczeń rynku kasowego.

Natomiast formalne udostępnienie powyższych usług nastąpi w dniu 4 sierpnia br.

Jednocześnie pragniemy dodać, że zmiany w regulacjach KDPW, związane z wdrożeniem rozrachunku w częściach, uzyskały pozytywną opinię Narodowego Banku Polskiego i w chwili obecnej oczekujemy na oficjalną decyzję KNF zatwierdzającą zmiany w Regulaminie KDPW. Niezwłocznie po otrzymaniu ww. decyzji nastąpi publikacja regulacji KDPW określająca termin wejścia w życie zmian wynikających z wdrożenia rozrachunku w częściach na dzień 4 sierpnia 2014 r.

KDPW\_CCP S.A.  
ul. Książęca 4  
00-498 Warszawa  
T 22 537 91 27  
F 22 627 31 11  
E ccp@kdpw.pl  
www.kdpwccp.pl

Ponadto, w celu umożliwienia nieprzerwanego testowania zarówno nowych usług (w środowisku TST B) jak i funkcjonowania systemu kdpw\_stream przy nieaktywnych ww. funkcjonalnościach, w dniu 9 czerwca br. w środowisku TST A zostanie zainstalowana nowa wersja systemu kdpw\_stream, która zostanie wdrożona do systemu produkcyjnego 28-29 czerwca br.

Jednocześnie informujemy, że rozważamy możliwość powtórzenia w środowisku TSTB testów bazujących na instrukcjach rozrachunku kopiowanych ze środowiska produkcyjnego. Informacja na ten temat zostanie Państwu przekazana odrębnym pismem, dotyczącym organizacji prowadzenia testów.

Wdrożenie zmian 28-29 czerwca br. oznacza w szczególności, że od dnia 30 czerwca br. (poniedziałek) w systemie produkcyjnym kdpw\_stream będą zaimplementowane następujące zmiany:

1. Wdrożenie nowych wersji komunikatów:

- a. semt.smt.001.03 – wyciąg z konta rozrachunkowego rynku kasowego (zamiast obecnej semt.smt.001.02);
- b. sese.ins.001.02 – instrukcja rozrachunku (zamiast obecnej wersji sese.ins.001.01);
- c. sese.sts.001.04 – status instrukcji rozrachunku/potwierdzenie rozrachunku (zamiast obecnej wersji sese.sts.001.03);
- d. sese.tec.001.02 – instrukcja techniczna (de facto nie następuje tutaj zastąpienie poprzedniej wersji komunikatu – obecnie produkcyjnie obsługiwana jest wersja sese.tec.001.02 – lecz poszerzenie opisu dopuszczalnych wartości dla kodu i typu operacji w specyfikacji tego komunikatu).

Jednocześnie przypominamy, że ww. nowe wersje komunikatów będą stosowane wyłącznie w relacji KDPW – uczestnicy KDPW, bez wpływu na komunikaty stosowane w relacji KDPW\_CCP – uczestnicy rozliczający KDPW\_CCP.

Nowe rodzaje komunikatów: semt.nta.001.01 (status transakcji składowych wchodzących w skład instrukcji netto), semt.nta.002.01 (zestawienie rozrachowanych transakcji składowych instrukcji netto) będą obsługiwane przez system kdpw\_stream z dniem aktywacji ww. nowych usług, tj. od 4 sierpnia br. Do czasu wdrożenia funkcjonalności związanych z usługą tri-party repo nie będą również obsługiwane komunikaty tprp.ins.001.01 (instrukcja tri-party repo), tprp.stm.001.01 (zestawienie transakcji i stanów zabezpieczeń transakcji tri-party repo) oraz tprp.sts.001.01 (status instrukcji tri-party repo).

2. Wprowadzenie zmian związanych z II etapem projektu harmonizacji przepływów komunikatów rozrachunkowych rynku kasowego (stosowane wyłącznie w relacji KDPW – uczestnicy KDPW) systemu kdpw\_stream ze standardami międzynarodowymi:

- a. Ostateczne odrzucanie błędnych instrukcji rozrachunku

Instrukcje rozrachunku, które nie przejdą pomyślnie kontroli merytorycznej będą od razu ostatecznie odrzucane w systemie kdpw\_stream. Instrukcjom takim będzie nadawany status REJT.

- b. Wprowadzenie kodów ISO do oznaczania przyczyny błędu instrukcji rozrachunku  
Dla błędnej instrukcji rozrachunku, w polu RsnTp komunikatu statusu instrukcji sese.sts będzie przekazywany kod przyczyny błędu zgodny z normą ISO. W polu RsnTxt zostanie przedstawiony słowny opis błędu w języku angielskim poprzedzony wewnętrznym kodem błędu systemu kdpw\_stream.
- c. Status instrukcji w zależności od rzeczywistej daty rozrachunku  
Instrukcje rozrachunku, które będą mogły zostać rozrachowane w oczekiwanej dacie rozrachunku wskazanej w instrukcji uzyskują status PEND. Instrukcje rozrachunku, które nie będą mogły zostać rozrachowane w oczekiwanej dacie rozrachunku wskazanej w instrukcji i dla których próba rozrachunku będzie dokonywana w kolejnych dniach, uzyskują status PENF. Pierwszego dnia po przesłaniu instrukcji do KDPW, status poprawnej instrukcji będzie oznaczany kodem PEND (nie PENF), nawet jeśli w instrukcji została wskazana wsteczna data rozrachunku.
- d. Zmiany w oznaczeniach statusów instrukcji zawieszonych  
Instrukcje, które nie zostały rozrachowane ze względu na brak aktywów (instrumentów finansowych lub pieniędzy) uzyskują jeden z następujących kodów statusu i przyczyny błędu: PEND/LACK - w przypadku braku pokrycia w papierach (lub PENF/LACK, jeżeli rozrachunek nie jest możliwy w bieżącym dniu); PEND/MONY - w przypadku braku pokrycia w pieniądzu (lub PENF/MONY, jeżeli rozrachunek nie jest możliwy w bieżącym dniu). Jeżeli brak pokrycia występuje u kontrpartniera, oznaczenie przyczyny błędu będzie zmieniane odpowiednio na wartości: CLAC i CMON. Opisany powyżej kod statusu i przyczyny będzie utrzymywany do kolejnej próby rozrachunku (obecnie kod statusu instrukcji zawieszonych jest zmieniany na wartość: PEND/FUTU).

Uprzejmie informujemy, iż do Państwa dyspozycji są pracownicy grupy KDPW:

- w sprawie nettingu w papierach wartościowych - pod numerami telefonów Zespołu Rozliczeń KDPW\_CCP: (22) 537 93 11, (22) 537 94 99 lub mailowo na adres [ccp@kdpw.pl](mailto:ccp@kdpw.pl);

- w sprawie rozrachunku w częściach, repo - pod numerami telefonów Zespołu Rozrachunków KDPW: (22) 537 93 86, (22) 537 94 18 lub mailowo na adres [doro@kdpw.pl](mailto:doro@kdpw.pl).

Z poważaniem,

Sławomir Panasiuk

Wiceprezes Zarządu KDPW\_CCP S.A.