

Warszawa, 28 września 2018 r.

Uczestnicy KDPW
Uczestnicy KDPW_CCP

dot.: zmian w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP zaplanowanych na 2019 r.

Szanowni Państwo,

poniżej przedstawiamy informację o naszych planach na 2019 r. związanych ze zmianami w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP, wynikających ze zmian w zakresie świadczonych usług lub zmian regulacyjnych. Informacja obejmuje zarówno projekty, które planujemy wdrożyć w 2019 r. jak również projekty, które w 2019 r. będą na zaawansowanym etapie realizacji i będą związane z koniecznością zmian w Państwa systemach informatycznych w kolejnych latach.

Zgodnie z zasadą wprowadzania zmian systemowych w ramach okien wdrożeniowych (mającą na celu zwiększenie efektywności wdrożeń i umożliwienie Państwu zaplanowania stosownych zmian w systemach informatycznych z odpowiednim wyprzedzeniem), po analizie zakresów i harmonogramów projektów, na **2019 rok** zaplanowaliśmy jedno okno wdrożeniowe:

- jesienne okno wdrożeniowe – w terminie: **28-29 września**.

Lista projektów związanych ze zmianami w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP:

poniższa lista może ulec modyfikacji w przypadku zmian otoczenia zewnętrznego, w szczególności regulacyjnego i nowych potrzeb biznesowych:

JESIENNE OKNO WDROŻENIOWE – 28-29 września 2019 r.

1. Oznaczanie typów kodów operacji rozrachunkowych zgodnie ze standardami ISO 15022/20022 *dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obligatoryjne*

Mając na uwadze optymalizację procesu implementacji obsługi komunikatów ISO 20022, a także konieczność dostosowania poszczególnych obszarów funkcjonalnych do międzynarodowych praktyk rynkowych, KDPW we współpracy z grupą roboczą National Market Practice Group (NMPG PL) zamierza wprowadzić standardowe atrybuty operacji rozrachunkowych określane poprzez 4-znakowy typ operacji rozrachunku zgodny ze standardami ISO, kod rynku oraz tryb obrotu.

Materiały: Szczegółowe informacje dot. planowanych zmian przekazaliśmy Państwu pismami: SCP/ZW/16/2018 z dnia 1 czerwca 2018 r. oraz DR/ZW/7/2018 z dnia 6 sierpnia 2018 r.

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy w marcu 2019 r.

Wdrożenie: Po przeprowadzeniu dodatkowych konsultacji z przedstawicielami uczestników – Radą Banków Depozytariuszy i Izbą Domów Maklerskich, wdrożenie zaplanowano w ramach jesiennego okna wdrożeniowego 2019 r.; uruchomienie funkcjonalności nastąpi w dniu **30 września 2019 r.**

2. Standaryzacja obsługi pozostałych zdarzeń korporacyjnych, w których występuje wypłata świadczeń, w oparciu o normę ISO 20022

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW – obligatoryjne

W 2019 r. kontynuowany będzie kolejny etap prac projektowych związanych ze standaryzacją obsługi zdarzeń korporacyjnych, w oparciu o normę ISO 20022. Zakresem projektu objęte zostały następujące zdarzenia:

- częściowy, obligatoryjny wykup dłużnych papierów wartościowych na żądanie emitenta - kod zdarzenia: PCAL,
- częściowa spłata wartości nominalnej dłużnych papierów wartościowych realizowana na żądanie emitenta - kod zdarzenia: PCAL,
- częściowy, dobrowolny wykup dłużnych papierów wartościowych - kod zdarzenia: BIDS,
- dobrowolny wykup certyfikatów inwestycyjnych na żądanie uprawnionych - kod zdarzenia: BIDS,
- umorzenie certyfikatów inwestycyjnych w związku z likwidacją funduszu inwestycyjnego - kod zdarzenia: LIQU,
- wypłata dywidendy z opcją wyboru pożytków, realizowana w ramach dwóch zdarzeń - kody zdarzeń: DVOP i RHDI.

Materiały: Szczegółowe informacje dotyczące wymienionych powyżej zmian, w tym zasady wymiany komunikatów przekazaliśmy Państwu pismem DO/ZW/881/2018 z dnia 28 czerwca 2018 r.

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem planujemy w marcu 2019 r.

Wdrożenie: Zaplanowano w ramach jesiennego okna wdrożeniowego 2019 r., w związku z powiązaniem ww. funkcji z opisanymi w pkt. 1 zmianami dot. nowych oznaczeń kodów operacji; uruchomienie funkcjonalności nastąpi w dniu **30 września 2019 r.**

3. Wprowadzenie nowej metodyki obliczeń wpłat do funduszu rozliczeniowego i funduszy zabezpieczających

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW_CCP obrót zorganizowany i obrót OTC – obligatoryjne

KDPW_CCP prowadzi projekt mający na celu implementację zmian w mechanizmach aktualizacji wpłat i obliczeń udziałów w funduszu rozliczeniowym i w funduszach zabezpieczających. Zakres projektu przewiduje zmiany w procesie prowadzenia obliczeń wpłat do funduszu rozliczeniowego/zabezpieczających na poziomie instytucji, a nie indywidualnego kodu uczestnika w systemie KDPW_CCP, prowadzenia dziennej aktualizacji wpłat do funduszu rozliczeniowego/zabezpieczającego (zgodnie z obecną praktyką dany fundusz aktualizowany jest raz w miesiącu). Zmiany wynikają z konieczności dostosowania do praktyk rynkowych oraz zwiększenia efektywności systemu zarządzania ryzykiem rozliczeniowym.

Materiały: Szczegółowe materiały opisujące planowane zmiany w tym zakresie prześlemy Państwu w listopadzie 2018 r., natomiast informacje dotyczące zmian w strukturze komunikatów dotyczących wpłat do funduszy, prześlemy w styczniu 2019 r.

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy w maju 2019 r.

Wdrożenie: Zaplanowano w ramach jesiennego okna wdrożeniowego 2019 r., przy czym uruchomienie nowej metodyki obliczeń wpłat do funduszy nastąpi z pierwszym dniem kwartału tj. **1 października 2019 r.**

INNE WAŻNE PROJEKTY, PLANOWANE DO WDROŻENIA W 2019 ROKU (poza planowanymi oknami wdrożeniowymi), mogące mieć wpływ na Państwa systemy informatyczne:

4. Dostosowanie systemu kdpw_stream do wprowadzanej przez GPW zmiany precyzji prezentacji kursów

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW_CCP – obligatoryjne

W związku z planowanym rozpoczęciem przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie SA (GPW) w dniu 2 stycznia 2019 r. notowań akcji, kontraktów terminowych na akcje i kontraktów terminowych na waluty z dokładnością do czterech miejsc po przecinku, w KDPW_CCP prowadzony jest projekt mający na celu dostosowanie systemu kdpw_stream do wymaganych przez GPW zmian.

Ze względu na zmiany precyzji prezentacji kursów, zmianie ulegną niektóre komunikaty xml generowane przez KDPW_CCP (zmiana nazwy i zawartości komunikatu). W szczególności dotyczy to komunikatów, w których przekazywana jest informacja o kursie rozliczeniowym i cenie rozliczeniowej kontraktów terminowych lub kursie po jakim została zawarta transakcja w papierach wartościowych (dane bazodanowe).

Materiały: Szczegółowe informacje dotyczące ww. zmian, w tym nowe wersje komunikatów systemowych przekazaliśmy pismem CCP/ZW/579/2018 z dnia 1 sierpnia 2018 r. Podsumowanie przygotowanych zmian prześlemy Państwu odrębnym pismem pod koniec października 2018 r.

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy od 1 października 2018 r.

Wdrożenie: Wdrożenie rozwiązania zaplanowano na podstawie dotychczasowych informacji z GPW, w dniu **2 stycznia 2019 r.**

5. Uruchomienie usługi eVoting opartej o technologię blockchain w ramach zintegrowanej platformy do obsługi WZ

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW – obligatoryjne

W ramach prac realizowanych w obszarze nowych technologii, w 2018 r. KDPW zrealizował projekt badawczy koncentrujący się na rozpoznaniu technologii rozproszonych rejestrów, w tym blockchain, oraz możliwości zastosowania blockchain w ramach procesów biznesowych rynku kapitałowego. W wyniku projektu stworzone zostało pilotażowe rozwiązanie implementujące proces głosowania na Walnych Zgromadzeniach, które pozwoliło rozpoznać obszary wykorzystania oraz wyzwania, jakie stoją przy tworzeniu rozwiązań rozproszonych. Wnioski z projektu pozwoliły na podjęcie kolejnego przedsięwzięcia, ukierunkowanego na stworzenie platformy opartej o blockchain, przeznaczonej dla rynku kapitałowego, a także utworzeniu rozwiązania eVoting, zintegrowanego z obecnymi procesami obsługi Walnych Zgromadzeń. W ramach projektu planowane jest stworzenie nowej, odświeżonej aplikacji internetowej dla Emitentów, która pozwoli (oprócz dotychczasowych funkcjonalności związanych z przekazywaniem danych o uprawnionych do udziału w WZ) na opcjonalne skorzystanie z obsługi zdalnego głosowania nad uchwałami. Planowane jest także przygotowanie rozwiązania dla inwestora indywidualnego, dzięki któremu będzie on mógł wziąć udział w głosowaniu. W ramach prac nad nowym rozwiązaniem i tworzenia platformy do głosowania, analizie zostanie poddany zakres danych pozyskiwanych od uczestników w zakresie listy uprawnionych do głosowania, pod kątem zapewnienia informacji pozwalających na dodatkowe potwierdzenie uprawnień inwestora. W trakcie tworzenia ww. rozwiązania KDPW zamierza zaproponować uczestnikom możliwość partycypacji w testach rozproszonej sieci DLT, poprzez utworzenie własnych węzłów przyłączonych do platformy blockchain.

Materiały: Szczegółowe informacje dot. nowych rozwiązań prześlemy Państwu na początku 2019 r.

Testy: Przeprowadzenie testów planujemy na przełomie I/II kwartału 2019 r.

Wdrożenie: Spodziewany termin zakończenia przedsięwzięcia to **połowa 2019 r.**

6. Uruchomienie obsługi raportowania transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (repozytorium SFTR)

dostosowanie systemów informatycznych wymagane wobec uczestników planujących korzystanie z tej usługi

KDPW jako podmiot prowadzący repozytorium transakcji planuje rozszerzyć zakres świadczonych usług dla uczestników rynku o usługę repozytorium SFTR (raportowania transakcji finansowanych z użyciem

papierów wartościowych (repo, sell/buy back, pożyczki papierów wartościowych)). Zapisy Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. (rozporządzenie SFTR) przewidują obowiązek zgłaszania szczegółowych informacji o transakcjach SFT zawieranych przez wszystkich uczestników rynku, niezależnie od tego, czy są to podmioty finansowe czy niefinansowe. KDPW posiadając zautomatyzowane i zabezpieczone interfejsy komunikacyjne oraz wypracowany model współpracy z nadzorcami i uczestnikami planuje zaoferować rozwiązanie, które podmiotom zobowiązanym do raportowania zapewni prawidłowe i sprawne wywiązanie się z obowiązku raportowego, a dotychczasowym klientom przyniesie wymierne korzyści płynące z możliwości raportowania wszystkich wymaganych transakcji (zgodnie z wymogami rozporządzeń EMIR, MIFIR, SFTR) do jednego dostawcy usług.

Mając na uwadze standard wymiany komunikatów wprowadzony przez ESMA w ramach raportowania pod rozporządzeniem MIFIR prawdopodobne jest, że wraz z wejściem w życie Standardów technicznych dot. raportowania transakcji SFT, ESMA opublikuje dla tego obszaru raportowania struktury komunikatów xml zgodne z normą ISO 20022.

Materiały: Szczegółowe materiały dotyczące nowej usługi (w tym publikacja na stronach internetowych specyfikacji i przykładów komunikatów xml) przekazemy Państwu na przełomie I/II kwartału 2019 r.

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów przewidujemy na przełomie III/IV kwartału 2019 r.

Wdrożenie: Zakładamy, że wdrożenie nastąpi w IV kwartale 2019 r.

Szczegółowy harmonogram prac projektowych, jak również precyzyjny termin wdrożenia zmian zostanie określony przez KDPW po publikacji Standardów technicznych.

Z uwagi na fakt, że do chwili obecnej nie jest znana ostateczna treść Standardów technicznych, jak również nie jest znany termin ich publikacji oraz wejścia w życie, terminy poszczególnych etapów niniejszego projektu mogą ulec zmianie.

7. Zmiana sposobu dostępu do aplikacji stosowanych przez GK KDPW poprzez www oraz do zasobów witryny www

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obligatoryjne

KDPW prowadzi projekt mający na celu utworzenie jednolitego systemu dostępowego do aplikacji i usług udostępnianych przez GK KDPW. System pozwolić będzie na uwierzytelnienie oraz autoryzację użytkowników do wszystkich usług, do których będą upoważnieni. Dodatkowo wprowadzone zostaną mechanizmy pozwalające na wykorzystanie wieloskładnikowego uwierzytelnienia. W ramach tworzonego rozwiązania analizie zostaną poddane również kwestie zapewnienia integralności komunikacji i podpisywania cyfrowego przesyłek. W chwili obecnej trwają prace nad stworzeniem pilotażowego rozwiązania, po weryfikacji którego możliwe będzie uruchomienie rozwiązania w otoczeniu produkcyjnym. W pierwszej kolejności rozwiązanie wykorzystywane będzie w ramach nowotworzonych usług i aplikacji. W dalszej kolejności planowane będą działania zmierzające do dostosowania już funkcjonujących w KDPW i KDPW_CCP systemów i usług, przy możliwie małym wpływie na systemy uczestników.

Wdrożenie: Spodziewany termin zakończenia pierwszego etapu przedsięwzięcia to **połowa 2019 r.**

8. Opracowanie nowego webowego interfejsu usług dla klientów Grupy kapitałowej KDPW *dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – fakultatywne*

KDPW podążając za rozwojem usług internetowych, prowadzi prace nad uzupełnieniem swojej oferty w zakresie komunikacji (wymiany danych) z klientami. W ramach tych prac planuje uruchomienie interfejsu U2A (platformy technologicznej) dostępnego dla uczestników KDPW i KDPW_CCP, a także klientów korzystających z pozostałych usług Grupy kapitałowej KDPW, za pomocą przeglądarki internetowej. Nowy kanał komunikacyjny początkowo zapewni będzie wybrane funkcjonalności (np. kdpw_stream dla CCP oraz CSD). W kolejnych etapach planowane jest sukcesywne uruchamianie obecnych i przyszłych usług świadczonych w trybie U2A. Zakładamy, że interfejs webowy będzie szczególnie użyteczny dla tych klientów, którzy nie będą mieli potrzeby korzystania z kanału A2A.

Wdrożenie: Spodziewany termin zakończenia pierwszego etapu przedsięwzięcia to **połowa 2019 r.**

9. Wprowadzenie komunikacji z systemami KDPW poprzez sieć MPLS *dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – fakultatywne, docelowo obowiązkowe*

KDPW prowadzi prace rozwojowe zmierzające do umożliwienia komunikowania się Uczestników z systemami KDPW przez sieć MPLS przy użyciu infrastruktury telekomunikacyjnej operatorów Orange Polska i Exatel S.A. Produkcyjne uruchomienie sieci MPLS po stronie KDPW i rozpoczęcie procesu podłączania zainteresowanych Uczestników, jest wstępnie planowane na styczeń 2019 roku. Istniejące obecnie inne sposoby komunikacji z KDPW, w tym przede wszystkim oparte o sieć Frame-Relay pozostaną nadal aktywne. Docelowo sieć MPLS zastąpi sieć Frame-Relay, której wygaszanie rozpocznie się nie wcześniej niż w 2020 roku i będzie procesem rozłożonym w czasie.

O postępach prac będziemy informować Państwa na bieżąco w odrębnej korespondencji.

WDROŻENIA PLANOWANE w 2020 i 2021 r.

10. Dostosowanie do wymogów CSDR – II etap *dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obowiązkowe*

W związku z publikacją w dniu 13 września 2018 r. Standardów technicznych dotyczących obszaru dyscypliny rozrachunku (Rozporządzenie Komisji UE 2018/1229), potwierdzamy, że w ramach drugiego etapu projektu związanego z autoryzacją KDPW zgodnie z rozporządzeniem CSDR, planujemy wprowadzenie zmian w systemach informatycznych, mających na celu osiągnięcie niezbędnego stopnia dostosowania do wymogów w zakresie dyscypliny rozrachunku. Zmiany obejmą implementację nowego systemu do naliczania kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek i związane z tym raportowanie oraz odpowiednie dostosowanie funkcjonalności wspomagających procesy rozrachunkowe.

W ramach tego etapu projektu zamierzamy wprowadzić zmiany związane z funkcjonalnościami wspomagającymi płynność rozrachunku oraz wymogami w obszarze przechowywania danych, w szczególności:

- zmiany w funkcjonalności „tolerance level”,
- zmiany w obszarze odwoływania instrukcji rozrachunku,
- obsługa w instrukcji rozrachunkowej pola "Place of clearing",
- zmiany w funkcjonującym już obecnie mechanizmie hold-release,
- modyfikacje w funkcjonalności rozrachunku w częściach, oraz zmiany związane z obszarem dyscypliny rozrachunku:
- nowy system naliczania kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek, w tym redystrybucja naliczonych kwot do kontrahentów,
- implementacja nowych zasad wyceny papierów wartościowych,
- mechanizmy monitoringu uczestników w zakresie terminowości rozrachunku i oceny efektywności rozrachunku oraz mechanizmy raportowania w zakresie dyscypliny rozrachunku,
- nowe mechanizmy wspomagania procesu odkupu papierów na otwartym rynku (buy-in).

Materiały: Wstępny opis planowanych zmian, oparty na projekcie standardów technicznych dotyczących dyscypliny rozrachunku, został Państwu przekazany pismem SP/ZW/3/2016 z 9 maja 2016 r. Planowany termin udostępnienia szczegółowych materiałów dotyczących planowanych zmian, to kwiecień 2019 r. Pragniemy jednakże zaznaczyć, że intencją KDPW jest wykorzystanie komunikatów opartych na standardowych rozwiązaniach opracowanych w ramach grup roboczych (w szczególności SMPG) i zgodnych z normami ISO. Z tego powodu istnieje duża zależność w zakresie dystrybucji materiałów od wyników prac związanych z opracowaniem standardowych komunikatów zgodnych z normami ISO.

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów przewidujemy w kwietniu 2020 r.

Wdrożenie: Wdrożenie powyższych zmian nastąpi we wrześniu 2020 r. Rozporządzenie zawierające standardy techniczne wchodzi w życie 24 miesiące po jego opublikowaniu, co z perspektywy praktycznej oznacza, że najpóźniejszym terminem implementacji zmian jest 14 września 2020 r.

11. Wprowadzenie komunikatów FpML w obszarze rozliczeń derywatów OTC

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW_CCP – fakultatywne, docelowo obligatoryjne

W KDPW_CCP prowadzone są prace projektowe zmierzające do zaoferowania uczestnikom KDPW_CCP nowych rozwiązań do komunikacji, w tym przygotowania do wprowadzenia nowoczesnych rozwiązań w zakresie dostępu uczestników do dedykowanych elementów systemu (GUI) i wymiany komunikatów FpML. Proces rozpoznania standardu FpML oraz przygotowania specyfikacji wraz z obsługą komunikacyjną nowych komunikatów rozliczeniowych znajduje się w fazie wstępnej. W celu wypracowania obszaru zastosowania nowego standardu komunikacyjnego, KDPW_CCP planuje zaprosić uczestników do współpracy i w tym celu zamierza powołać grupę roboczą.

Zakładamy, że wprowadzenie nowoczesnych rozwiązań pozwoli na podniesienie standardu świadczonych usług rozliczeniowych (standaryzacja komunikatów, szybkość działania), a także wpłynie na efektywność i elastyczność rozwiązań w zakresie usług rozliczeniowych.

Materiały: Szczegółowe informacje dot. planowanych zmian prześlemy w listopadzie 2019 r.

Wdrożenie: Przewidujemy, że wdrożenie nowego standardu (komunikatów FpML) nastąpi najwcześniej w 2021 r.

Z poważaniem,

PREZES ZARZĄDU
KDPW S.A.

M. Trybuchowski
Mociej Trybuchowski

WICEPREZES ZARZĄDU
KDPW S.A.

P. Górecki
Paweł Górecki

WICEPREZES ZARZĄDU
KDPW S.A.

Sławomir Panasiuk
Sławomir Panasiuk

WICEPREZES ZARZĄDU
KDPW S.A.

Michał Stępniewski
Michał Stępniewski

Do wiadomości:

Narodowy Bank Polski

Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

Bond Spot S.A.

Izba Domów Maklerskich

Rada Banków Depozytariuszy przy ZBP