

Warszawa, 6 listopada 2018 r.

Uczestnicy KDPW
Uczestnicy KDPW_CCP

dot.: wdrożeń w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP w ramach jesiennego okna wdrożeniowego (17-18 listopada 2018 r.)

Szanowni Państwo,

w nawiązaniu do wcześniejszej korespondencji (SCP/ZW/19/2017 i CCP/ZW/661/2017 z dnia 29 września 2017 r.) oraz Uchwały Zarządu KDPW S.A. nr 668/2018 z dnia 5 listopada 2018 r., pragniemy uprzejmie potwierdzić, że w terminie 17-18 listopada 2018 r., w systemach informatycznych GK KDPW wprowadzone zostaną modyfikacje związane z wymienionymi poniżej projektami:

1. Wprowadzenie obsługi komunikatów ISO 20022 w obszarze rozrachunku – II etap

KDPW udostępni obsługę kolejnych komunikatów ISO 20022 w obszarze rozrachunku, takich jak:

- lista stanów posiadania – semt.002.001.09;
- instrukcja zmiany statusów aktywów – semt.013.001.04;
- zlecenie usunięcia instrukcji rozrachunku - sese.020.001.05;
- zapytanie o status instrukcji - sese.021.001.04;
- powiadomienie o oczekującej instrukcji kontrpartnera (allegement) – sese.028.001.06;
- modyfikacja warunków instrukcji rozrachunku – sese.030.001.07.

Wdrażane rozwiązanie ma charakter fakultatywny i dotyczy jedynie tych uczestników, którzy zamierzają skorzystać z nowej oferty Krajowego Depozytu (komunikaty ISO20022 będą obsługiwane w systemie kdpw_stream równolegle z komunikatami xml KDPW oraz komunikatami MT).

Informacje dotyczące zakresu obsługiwanych komunikatów i procesów rozrachunkowych zostały opisane w piśmie DR/ZW/6/2018 z 29 czerwca 2018 r., a struktury obsługiwanych komunikatów zostały opublikowane na platformie *MyStandards*.

Institucje, które są zainteresowane wdrożeniem wymienionych komunikatów w ramach jesiennego okna wdrożeniowego (17-18 listopada 2018 r.), a do chwili obecnej nie skorzystały z możliwości przeprowadzenia testów, prosimy o kontakt z Marcinem Zawistowskim (marcin.zawistowski@kdpw.pl) w celu ustalenia terminu i zakresu testów.

Więcej informacji na www.kdpw.pl, w zakładce Usługi/Rozwój/[Standaryzacja zasad wymiany komunikatów rozrachunkowych](#).

2. Zmiana modelu instrukcji złożonych

W ślad za postulatami zgłaszanymi przez uczestników oraz w następstwie przeprowadzonych na forum grupy roboczej S&R NMPG PL konsultacji, KDPW wdroży nowy, uproszczony mechanizm łączenia instrukcji rozrachunku. Model uproszczony będzie dodatkowym/alternatywnym wariantem łączenia instrukcji rozrachunku (nadal funkcjonować będą dotychczasowe reguły łączenia instrukcji poprzez przekazywanie wspólnego identyfikatora grupy instrukcji).

Szczegółowe materiały opisujące planowane zmiany w tym zakresie przekazaliśmy pismem DO/ZW/595/2018 z 27 kwietnia 2018 r.

Zgodnie z informacją zawartą w piśmie: DO/ZW/1465/2018 z 16 października 2018 r. oraz DO/ZW/1529/2018 z 29 października 2018 r., możliwość testowania nowego mechanizmu w środowisku testowym (TST B) udostępniona została od 29 października 2018 r.

Więcej informacji na www.kdpw.pl, w zakładce: Usługi/Rozwój/[Standaryzacja zasad wymiany komunikatów rozrachunkowych](#).

3. Wprowadzenie możliwość zmiany systemu rozrachunku pomiędzy RTGS a MB

W ramach jesiennego okna wdrożeniowego, KDPW wdroży do systemu `kdpw_stream` funkcjonalność będącą kolejnym postulatem zgłoszonym w ramach prac grupy roboczej S&R NMPG PL - dodana zostanie możliwość zmiany deklarowanego systemu rozrachunku pomiędzy: rozrachunkiem w systemie rzeczywistym (RTGS) a rozrachunkiem w systemie wieloseesyjnym.

Szczegółowe informacje w tym zakresie przekazane zostały pismem DO/ZW/1286/2018 z 11 września 2018 r.

Zgodnie z pismem DO/ZW/1529/2018 z 29 października 2018 r., przeprowadzenie testów ww. funkcjonalności możliwe jest w środowisku testowym (TST B) od 29 października 2018 r.

Więcej informacji na www.kdpw.pl, w zakładce: [kdpw_stream/Dokumentacja systemu/Planowane zmiany](#).

4. Dzielenie komunikatów z analityką do nettingu na mniejsze fragmenty (wykorzystanie mechanizmu stronicowania, zgodnego z zasadami stosowanymi w podobnych komunikatach ISO150022/ISO20022)

W związku z postulatami części uczestników, wprowadzone zostaną zmiany w obsłudze raportów analitycznych udostępnianych przez KDPW w przypadku rozrachunku instrukcji netto przekazanych

przez KDPW_CCP. Ze względu na pojawiające się przypadki osiągnięcia przez te raporty bardzo dużych rozmiarów, zostaną wprowadzone mechanizmy dzielenia ich na mniejsze fragmenty.

Szczegółowe informacje na ten temat przekazaliśmy pismami: DO/ZW/594/2018 z 27 kwietnia 2018 r., DO/ZW/1047/2018 z 20 lipca 2018 r. oraz DO/ZW/1395/2018 z 3 października 2018 r.

Od 15 października 2018 r. udostępniliśmy środowisko testowe (TST B) i możliwość testowania nowej funkcjonalności.

Więcej informacji na www.kdpw.pl, w zakładce: [kdpw_stream/Dokumentacja systemu/Planowane zmiany](#).

5. Przekazywanie uczestnikom rozliczającym Informacji o wypracowanych pożytkach od środków zgromadzonych w systemie gwarantowania rozliczeń

KDPW_CCP wprowadzi nową funkcjonalność w systemowej obsłudze pożytków od środków zgromadzonych jako depozyty zabezpieczające i udziały w funduszach, umożliwiającą cykliczne przekazywanie danych o wypracowanych pożytkach na poziomie zdefiniowanych w systemie kdpw_stream kont zabezpieczeń (PB), prowadzonych dla uczestnika rozliczającego (z dokładnością do NKK).

Szczegółowe informacje dotyczące ww. zmian, w tym informacje dot. struktury komunikatu przekazaliśmy pismem CCP/ZW/731/2018 z 19 października 2018 r.

Prowadzenie testów ww. funkcjonalności możliwe jest w środowisku testowym (TST B) od 22 października 2018 r.

Więcej informacji na www.kdpwccp.pl, w zakładce: [Uczestnicy/komunikaty kdpw_stream/zmiany komunikatów](#) i [Uczestnicy/komunikaty kdpw_otc/planowane zmiany](#).

Z poważaniem,

PREZES ZARZĄDU
KDPW S.A.
M. Trybuchowski
Maciej Trybuchowski

WICEPREZES ZARZĄDU
KDPW S.A.
Sławomir Panasiuk
Sławomir Panasiuk

Do wiadomości:

Narodowy Bank Polski

Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.

BondSpot S.A.

Izba Domów Maklerskich

Rada Banków Depozytariuszy przy ZBP