

Zasady walidacji transakcji kierowanych przez MarkitSERV do KDPW_CCP

1. MarkitSERV

W przypadku transakcji przekazywanych do KDPW_CCP z MarkitSERV obowiązują następujące zasady:

1.1. Wskazywanie KDPW_CCP jako Izby Rozliczeniowej (CCP)

Do systemu kdpw_otc przyjmowane są jedynie transakcje, które wskazują KDPW_CCP jako CCP. Można to wykonać na dwa sposoby :

- a. Strona rozpoczynająca proces potwierdzania wybiera KDPW_CCP jako “bilateral clearing house”, druga strona transakcji (oryginalny kontrpartner) wyraża na to zgodę.
- b. Strona rozpoczynająca proces potwierdzania wybiera KDPW_CCP jako “private clearing house”, druga strona transakcji (oryginalny kontrpartner) ustawia KDPW_CCP jako „private clearing house”.

1.2. Metody przesyłania transakcji do rozliczeń

Istnieje możliwość zaznaczenia “Auto send for clearing”. W takim przypadku, transakcja jest automatycznie wysyłana po wykonaniu opcji “release” (pod warunkiem spełniania wszystkich wymagań). W innym przypadku, obydwie strony muszą dokonać jednostronnego wzbogacenia (unilaterall amend) transakcji, zmieniając opcję “send for clearing” na “yes”. MarkitSERV odpowiada za wysłanie do KDPW_CCP tylko tych transakcji, które powinny zostać skierowane do rozliczeń w KDPW_CCP.

1.3. Przesyłanie transakcji do rozliczeń

Do rozliczeń w KDPW_CCP wysyłane są transakcje z zaznaczoną opcją “Released” spełniające warunki z pkt. 1.1 oraz 1.2.

1.4. Ustanawianie wymagalności pól w MarkitSERV

Istnieje możliwość zmiany domyślnych ustawień wymagalności pól w MarkitSERV. Na przykład istnieje możliwość zmiany pola “Internal trade ID” znajdującego się w zakładce “Internal Data” na obowiązkowe.

1.5. Transakcje klientów

KDPW_CCP i MarkitSERV pracują nad rozwiązaniem umożliwiającym wysyłanie z MarkitSERV do KDPW_CCP transakcji klientów. Informacje na temat sposobu zawierania tego rodzaju transakcji zostaną Państwu wkrótce przekazane.

1.6. Transakcje wewnętrzne

W przypadku gdy UR potrzebuje wykonać transakcje wewnętrzną (pomiędzy dwoma swoimi kontami), musi mieć zarejestrowane dwa oddzielne kody BIC w MarkitSERV wewnątrz jednego Uczestnika. Nie ma możliwości wysłania transakcji do rozliczeń używając jednego kodu BIC.

1.7. Wskazywanie konta

Uczestnik Rozliczający powinien wskazać swoje konto w polu “netting string”. Wskazane konto jest tłumaczone na format:

PA-XXXX-1234567890

Gdzie XXXX jest to kod UR a 1234567890 jest wskazanym numerem konta. Przykład użycia:
Netting string: 1234567890

1.8. Poprawność konta

KDPW_CCP sprawdza czy konto wskazane w polu netting string jest poprawnym kontem PA wewnątrz struktury kont UR.

1.9. Rodzaj transakcji

Do rozliczeń przyjmowane są wyłącznie instrumenty rozliczane przez KDPW_CCP. Szczegółowy opis zasad walidacji jest zdefiniowany w załączniku do Szczegółowych Zasady Systemu Rozliczeń OTC.

1.10. Ponowne przesyłanie transakcji do rozliczeń

Istnieje możliwość ponownego wysłania transakcji do systemu kdpw_otc. Operacja ta powinna być wykonywana WYŁĄCZNIE w przypadku gdy transakcja otrzymała status ‘Rejected’ w wyniku podania błędnego konta.

Transakcja jest wysłana ponownie poprzez wykonanie opcji “unilateral amend” oraz zmienienia pola „netting string”.

1.11. Przesyłanie statusu transakcji

Obecnie nie wspierane jest aktualizowanie statusu transakcji w MarkitSERV. Wyłącznie pierwszy status jest odzwierciedlony. Oznacza to, że w przypadku gdy transakcja otrzyma status QUEUED po czym zostanie on zmieniony na Accepted/Rejected zmiana ta nie jest odzwierciedlana na MarkitSERV.

1.12. Wycofywanie transakcji

Nie ma możliwości wycofywania transakcji z KDPW_CCP. Wyłączna możliwość “odwołania” transakcji polega na przesłaniu transakcji odwrotnej oraz włączeniu kompensacji transakcji na danym koncie.