

KONTA – PODSTAWOWE INFORMACJE

Uzyskanie Numerów Klasyfikacyjnych Klienta (NKK) i otwarcie kont rozliczeniowych, na których są rejestrowane transakcje zestawione na platformie confirmacji (MarkitWire) jest niezbędne do działania w systemie kdpw_otc.

Konta służące rejestracji transakcji w obrębie izby rozliczeniowej:

Konto formalne

Uczestnik mający na celu rozliczanie transakcji z rynku OTC musi posiadać konto formalne utworzone w KDPW_CCP. Konto formalne jest obowiązkowe, ponieważ stanowi podstawę do otwierania kont rozliczeniowych za pomocą komunikatów xml. W środowisku produkcyjnym jest ono otwierane na podstawie uchwały Zarządu KDPW_CCP, podejmowanej na wniosek uczestnika. Dla celów środowiska testowego wystarczy wysłać prośbę na adres mailowy izby (ccp@kdpw.pl). Konto formalne może zostać utworzone dla pozycji własnych albo klientów.

Numer Klasyfikacyjny Klienta (NKK)

NKK jest podstawowym i niezbędnym atrybutem konta rozliczeniowego przypisanym do klienta i opisującym jego podstawowe cechy. Numer klasyfikacyjny klienta jest nadawany na podstawie dyspozycji otwarcia konta na wniosek uczestnika rozliczającego. Proces przebiega automatycznie poprzez wysłanie komunikatu XML Instrukcja dotycząca NKK ([acmt.rqc.001.02](#)). W związku z usługą polegającą na przekazywaniu przez KDPW_CCP, na zlecenie uczestnika rozliczającego, raportów o kontraktach pochodnych rozliczanych przez KDPW_CCP do KDPW_TR, w strukturze komunikatu ([acmt.rqc.001.02](#)) istnieją następujące pola:

- 2.4 -2.8 – podstawowe dane kontrahenta,
- 2.9 (2.9.1 – 2.9.6) – szczegółowe dane kontrahenta.

Pole Branża, do której należy klient (CorpSctr pole 2.9.3) może przyjmować następujące wartości:

- A – zakład asekuracyjny,
- C – instytucja kredytowa,
- F – firma inwestycyjna,
- I – zakład ubezpieczeniowy,
- L – alternatywny fundusz ubezpieczeniowy,
- O – instytucja powierniczych programów emerytalnych,
- R – zakład reasekuracji,
- U – UCITS przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania.

Kontrahenci w rozumieniu rozporządzenia EMIR, przy raportowaniu kontraktów pochodnych do repozytorium transakcji, mają obowiązek posługiwania się kodem LEI, który będzie wymagany w przypadku zgłaszania transakcji przez KDPW_CCP. Więcej informacji, jak uzyskać kod LEI na

www.kdpw.pl w zakładce [KDPW LEI](#). Otwarcie NKK odbywa się natychmiast, potwierdzeniem tego faktu jest zwrotny komunikat statusowy z wartością PACK (acmt.stc.001.02).

Konto rozliczeniowe

Konto rozliczeniowe jest podstawowym urządzeniem ewidencyjnym tworzonym w celu rejestracji transakcji. Jest ono otwierane również automatycznie poprzez przesłanie do systemu KDPW_CCP komunikatu XML ([acmt.rqa.002.02](#)) – Instrukcja dotycząca konta.

Otwarcie konta rozliczeniowego (CRTA) odbywa się natychmiast, potwierdzeniem tego faktu jest komunikat statusowy z wartością PACK ([acmt.sta.002.02](#)). Zamknięcie i zmiana charakterystyki konta rozliczeniowego odbywa się na koniec dnia, potwierdzeniem tego faktu jest komunikat statusowy – ([acmt.sta.002.02](#)) z wartością PACK.

Potwierdzeniem przyjęcia żądania zamknięcia konta rozliczeniowego (CLSA) lub zmiany w koncie rozliczeniowym (CHGA) jest otrzymanie statusu PEND w komunikacie statusowym. Na potrzeby raportowania do repozytorium transakcji, w komunikacie znajduje się pole: 3.3.6 – RprtAu - Autoryzacja dla KDPW_CCP do raportowania - Y lub N Określa ono, czy uczestnik deleguje na KDPW_CCP zgłaszanie kontraktów pochodnych do repozytorium prowadzonego przez KDPW zarejestrowanych na danym koncie rozliczeniowym – w takim przypadku należy flagę raportowania ustawić w wartości „Y”. Zmiana flagi jest możliwa poprzez wysłanie komunikatu ([acmt.rqa.002.02](#)) z funkcją CHGA.

Konto zabezpieczeń

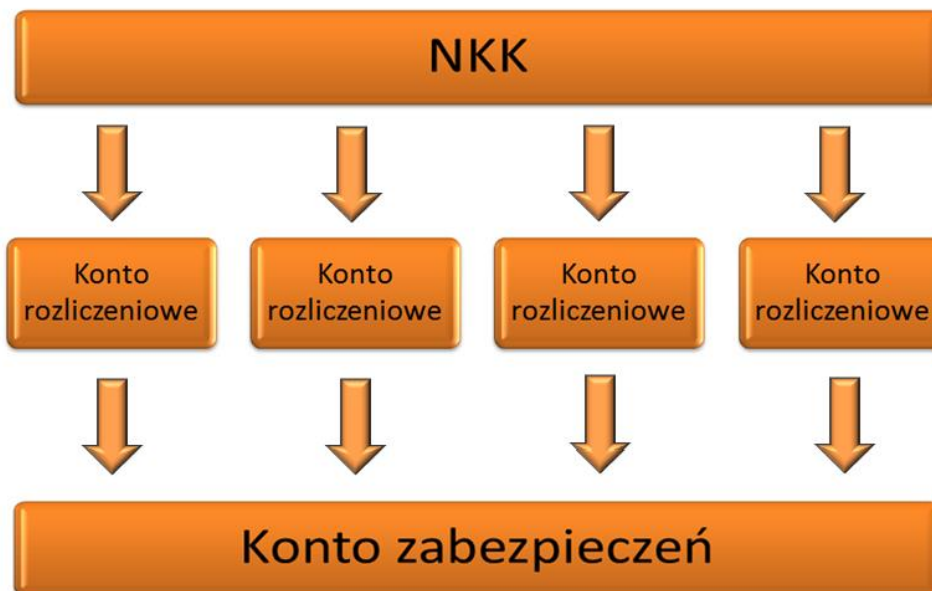
Do każdego pierwszego konta rozliczeniowego dla NKK automatycznie tworzone jest przyporządkowane do niego konto zabezpieczeń, prowadzone przez KDPW_CCP w systemie rozliczeń transakcji w celu wyliczania zabezpieczeń stanowiących:

- depozyt wstępny,
- właściwy depozyt zabezpieczający.

Konta zabezpieczeń budowane są zawsze na podstawie wybranych atrybutów kont rozliczeniowych:

- typ własności,
- typ uczestnictwa,
- umowa reprezentacji,
- NKK (atrybuty określający portfel oraz rodzaj konta nie będą uwzględniane).

Diagram przedstawia powiązanie NKK, konta rozliczeniowego i konta zabezpieczeń:



Zabezpieczenia, z wyłączeniem funduszu zabezpieczającego OTC, przechowywane są w rejestrze zabezpieczeń i zapisywane „na poziomie” kont zabezpieczeń. W przypadku funduszu zabezpieczającego OTC i depozytu dodatkowego OTC, zabezpieczenia przechowywane są „na poziomie” kodu uczestnika rozliczającego.

Założenie konta rozliczeniowego skutkuje weryfikacją, czy istnieje już odpowiednie konto zabezpieczeń w dedykowanym zbiorze, jeśli nie, zostanie ono założone.

Proces zamykania kont zabezpieczeń odbywa się w ramach zakończenia dnia, wtedy również wykonywana jest weryfikacja, czy odpowiednie konto zabezpieczeń może zostać zamknięte (o ile nie ma żadnych otwartych kont rozliczeniowych odpowiadających kontu zabezpieczeń).

Używanie identyfikatora konta na platformach

Na platformie MarkitWire identyfikator konta jest podawany w instrukcji afirmacyjnej. W tym celu w zakładce „Clearing” pole „Netting string” należy wypełniać identyfikatorem istniejącego konta rozliczeniowego. W przypadku, gdy nie podano identyfikatora konta, lub podano błędny identyfikator konta, system odrzuci transakcję i nie zostanie ona przyjęta do rozliczenia w KDPW_CCP.