

OBSŁUGA ZABEZPIECZEŃ W ŚRODKACH PIENIĘŻNYCH W EUR

SPIS TREŚCI

1. WSTĘP.....	1
2. KOMUNIKAT STATUSOWY COLR.STS.001.XX.....	1
3. OBSŁUGA ŚRODKÓW PIENIĘŻNYCH W EUR WNOSZONYCH NA ZABEZPIECZENIE	1

1. WSTĘP

Niniejszy dokument opisuje funkcjonalności związane z rejestrem zabezpieczeń prowadzonym w KDPW_CCP w ramach obsługi środków pieniężnych w EUR stanowiących zabezpieczenie.

Wymaganie z tytułu depozytów zabezpieczających oraz funduszy jest zawsze wyznaczone w walucie PLN, bez względu na to, czy wynika z transakcji rozliczanych w PLN czy EUR. Zabezpieczenie do tej pory mogły stanowić jedynie aktywa nominowane w PLN – środki pieniężne lub papiery wartościowe. Nową funkcjonalnością jest możliwość zabezpieczenia ekspozycji poprzez wniesienie środków pieniężnych w EUR lub papierów wartościowych nominowanych w EUR.

2. KOMUNIKAT STATUSOWY COLR.STS.001.XX

Komunikat statusowy - colr.sts.001.xx wysyłany jest przez KDPW_CCP w odpowiedzi na dyspozycję wniesienia/zwolnienia zabezpieczenia colr.ins.001.xx. Komunikat statusowy colr.sts.001.xx wysyłany jest niezależnie od tego, jakie zabezpieczenie stanowi przedmiot dyspozycji, a także w jakiej walucie jest nominowane. Komunikat dla uczestnika rozliczającego oprócz statusu powiela dane przekazane w dyspozycji uczestnika. Dodatkowo komunikat colr.sts.001.xx ze statusem wskazującym na możliwość zrealizowania dyspozycji, a potem jej zrealizowanie, wraz z dedykowanymi informacjami, wysyłany jest do płatnika uczestnika rozliczającego. Możliwe są następujące statusy instrukcji:

PEND	Instrukcja przyjęta
PENF	Instrukcja oczekuje na akceptację KDPW_CCP lub oczekuje na realizację
SETL	Zabezpieczenia zostały wniesione lub zwolnione
CAND	Instrukcja odrzucona, wraz z przyczyną odrzucenia

3. OBSŁUGA ŚRODKÓW PIENIĘŻNYCH W EUR WNOSZONYCH NA ZABEZPIECZENIE

3.1. Wymogi prawne i organizacyjne

Środki pieniężne w EUR można wносить na:

- wstępny depozyt rozliczeniowy (MARI),
- właściwy depozyt zabezpieczający (MARS),
- depozyt wstępny OTC (OTCL),
- właściwy depozyt zabezpieczający OTC (OTCM),

- wstępny depozyt rozliczeniowy ASO (MAGB),
- właściwy depozyt zabezpieczający ASO (MATS),
- fundusz rozliczeniowy (PRRG),
- fundusz zabezpieczający OTC (FOTC),

fundusz zabezpieczający ASO GPW BondSpot (PAGB). W przypadku wnoszenia lub zwalniania środków pieniężnych w EUR należy spełnić warunki formalne, tzn. w sytuacji, gdy uczestnik nie jest sam dla siebie płatnikiem, dostarczyć oświadczenie uczestnika rozliczającego wskazującego płatnika dla EUR oraz oświadczenie tego płatnika biorącego na siebie obowiązek realizacji przelewów w EUR dla danego uczestnika rozliczającego. Oświadczenia powinny wskazywać numer rachunku bankowego w systemie płatniczym wykorzystywanego do przelewów w EUR (wzory dokumentów dostępne w serwisie internetowym KDPW_CCP w zakładce Wzory dokumentów). Na tej podstawie KDPW_CCP odpowiednio rejestruje w systemie relację pomiędzy uczestnikiem rozliczającym a jego płatnikiem.

3.2. Wymogi operacyjne

Wnoszenie lub zwalnianie środków pieniężnych w EUR odbywa się na podobnych zasadach jak środków pieniężnych w PLN. W przypadku obsługi zabezpieczeń w postaci środków pieniężnych w EUR budowa komunikatu colr.ins.001.xx jest identyczna, jak dla mechanizmu wnoszenia i zwalniania środków pieniężnych w PLN, inny jest jedynie sposób wypełnienia pola dedykowanego wskazaniu kodu waluty.

Wartością pola, która w komunikacie colr.ins.001.xx wyróżnia proces wnoszenia środków pieniężnych w EUR, jest wartość 'EUR' w polu <Ccy>.

Przykład komunikatu:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<KDPWDocument Sndr="5003" Rcvr="0010" xsi:schemaLocation="urn:kdpw:xsd:colr.ins.001.xx colr.ins.001.xx.xsd"
xmlns="urn:kdpw:xsd:colr.ins.001.xx" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">
  <colr.ins.001.xx>
    <GnlInf>
      <SndrMsgRef>589746</SndrMsgRef>
      <CreDtTm>
        <Dt>2019-07-02</Dt>
      </CreDtTm>
    </GnlInf>
    <CollDtls>
      <BalTp>OTCL</BalTp>
      <Ccy>EUR</Ccy>
      <SttlmDt>2019-07-02</SttlmDt>
      <CollBal>
        <Bal>350000</Bal>
        <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd>
      </CollBal>
      <ClrgMmbInf>
        <ClrgMmbld>
          <KDPWMmbld>5003</KDPWMmbld>
          <KDPWSafAcct>111</KDPWSafAcct>
        </ClrgMmbld>
      </ClrgMmbInf>
    </CollDtls>
```

</colr.ins.001.x>
</KDPWDocument>

Dla dyspozycji zwalnającej środki sposób wypełniania pól w komunikacie jest analogiczny jak dla wniesienia, z tą różnicą, że należy przekazywać wartość 'DBIT' w polu <CdtDbtInd>.

Sposób akceptacji i proces zwalniania środków pieniężnych są uniwersalne bez względu na walutę obsługiwanego zabezpieczenia.

Po otrzymaniu dyspozycji od uczestnika, w przypadku gdy jest ona poprawna, uczestnik otrzyma komunikat colr.sts.001.xx ze statusem 'PEND', a płatnik uczestnika otrzyma komunikat colr.sts.001.xx, również ze statusem 'PEND'.

Gdy dyspozycja zostanie odrzucona (status 'CAND' wraz z przyczyną odrzucenia), to tę informację otrzyma jedynie uczestnik rozliczający. Płatnik nie będzie otrzymywał w tej fazie komunikatu ze statusem 'CAND'.

Na podstawie dyspozycji otrzymanej od uczestnika rozliczającego w postaci komunikatu, KDPW_CCP przesyła do systemu TARGET2 obsługiwanego przez Narodowy Bank Polski dyspozycję obciążającą lub uznającą rachunek bankowy uczestnika (lub jego płatnika).

Po wysłaniu dyspozycji do NBP uczestnik otrzyma komunikat colr.sts.001.xx ze statusem 'PENF', a płatnik uczestnika otrzyma komunikat colr.sts.001.xx, również ze statusem 'PENF'.

Gdy dyspozycja zostanie odrzucona (status 'CAND' wraz z przyczyną odrzucenia), to tę informację otrzyma uczestnik rozliczający i płatnik.

Jeżeli przelew obciążający rachunek bankowy płatnika zostanie zrealizowany, wówczas KDPW_CCP uzupełni o tę wartość rejestr zabezpieczeń prowadzony przez KDPW_CCP, jako wpłatę uczestnika rozliczającego na określony typ zabezpieczeń.

Po realizacji dyspozycji uczestnik otrzyma komunikat colr.sts.001.xx ze statusem 'SETL', a płatnik uczestnika otrzyma komunikat colr.sts.001.xx, również ze statusem 'SETL'.

Gdy dyspozycja zostanie odrzucona (status 'CAND' wraz z przyczyną odrzucenia), to tę informację otrzyma uczestnik rozliczający i płatnik.

Wprowadzona została godzina graniczna dla realizacji wnoszenia i zwalniania środków pieniężnych w EUR. Dla wniesienia środków pieniężnych jest to godzina 12:00, natomiast dla zwrotu godzina 14.00, co oznacza, że po tych godzinach dyspozycje od uczestników rozliczających będą odrzucane. Informacja ta przekazywana będzie w komunikatach statusowych colr.sts.001.xx z następującym kodem przyczyny: „Niewłaściwa godzina przekazania komunikatu”.

KDPW_CCP pobiera opłaty za zarządzanie środkami pieniężnymi nominowanymi w EUR, według tabeli opłat.

Na potrzeby limitów na typ zabezpieczenia środki pieniężne w EUR są traktowane jak środki pieniężne w PLN, czyli mogą stanowić do 100% wartości depozytów wstępnych, wymaganych depozytów

właściwych oraz wymaganych wpłat na fundusze. Należy jednak podkreślić, że nadwyżki w środkach pieniężnych w EUR nie są zwracane automatycznie, nie są także wypłacane pożyczki, jak to ma miejsce w przypadku środków w PLN wniesionych na poczet depozytów właściwych oraz wpłat na fundusze. Jeżeli uczestnik rozliczający chciałby dokonać zwolnienia środków w EUR, wówczas należy wysłać dyspozycję zwalniającą w postaci komunikatu colr.ins.001.xx.

Wycena środków pieniężnych w EUR na koniec dnia rozliczeniowego jest wykonywana na podstawie kursu pochodzącego z agencji informacyjnej Bloomberg pobieranego o godzinie 17:00 oraz wyznaczonej przez KDPW_CCP stopy redukcji. W przypadku wniesienia środków w trakcie dnia wykorzystany będzie kurs z dnia poprzedniego, również z uwzględnieniem stopy redukcji. W każdym komunikacie colr.sm1.002.xx (jest on wysyłany po każdej zmianie wartości danego typu zabezpieczenia oraz na koniec dnia) będą podane dwa kursy: przed skorygowaniem o stopę redukcji i po jej uwzględnieniu (w polach odpowiednio: <MktPric> i <ClctdPric>). Na potrzeby identyfikacji środków pieniężnych w EUR (np. w colr.sm1.002.xx) będzie wykorzystany następujący kod ISIN: EU0009656420.