

Uchwała Nr 31/20
Zarządu KDPW_CCP S.A.
z dnia 21 września 2020 r.

w sprawie zmiany Szczegółowych Zasad Prowadzenia Rozliczeń Transakcji (obrót zorganizowany)

Na podstawie § 2 ust. 1, 3 i 5 Regulaminu Rozliczeń Transakcji (obrót zorganizowany) oraz § 19 ust. 2 Statutu KDPW_CCP S.A., Zarząd KDPW_CCP S.A. postanawia, co następuje:

§ 1

W Szczegółowych Zasadach Prowadzenia Rozliczeń Transakcji (obrót zorganizowany) załącznik nr 8 otrzymuje brzmienie określone w załączniku do niniejszej uchwały.

§ 2

Uchwała wchodzi w życie z dniem 5 października 2020 r.

Maciej Trybuchowski
Prezes Zarządu

Sławomir Panasiuk
Wiceprezes Zarządu

Michał Stępniewski
Wiceprezes Zarządu

Piotr Jaworski
Członek Zarządu



Załącznik nr 8 do Szczegółowych Zasad Prowadzenia Rozliczeń Transakcji (obróć zorganizowany)

I. Oznaczenia operacji w systemie rozliczeń

Poszczególnym rodzajom operacji wykonywanych w systemie rozliczeń nadaje się następujące oznaczenia:

Lp.	Rodzaj operacji	Tryb operacji ¹	Kod rynku	Tryb obrotu	Faza operacji	Tryb zestawienia ²
1.	Rezygnacja z wykonania opcji	NE	IN	ZN		N
2.	Transfer pozycji dokonywany pomiędzy kontami tego samego uczestnika wykonywany w celu skorygowania błędnego wskazania konta rozliczeniowego	OI	IN	ZN		N
3.	Transfer pozycji zarejestrowanych na danym koncie w dniu poprzedzającym dzień realizacji transferu, wykonywany pomiędzy kontami oznaczonymi różnymi indywidualnymi numerami klasyfikacyjnymi, prowadzonymi dla tego samego uczestnika	OW	IN	ZN		N
4.	Transfer pozycji zajętych w wyniku transakcji zawartej na podstawie zbiorczego zlecenia wystawionego przez zarządzającego portfelem na rachunek klientów, dla których zarządzający realizuje jednakową strategię inwestycyjną, dokonywany z konta transakcyjnego na konto indywidualne klienta prowadzone dla tego samego uczestnika	OW	IN	ZN	BLOC	N
5.	Transfer pozycji zajętych w wyniku transakcji zarejestrowanej na danym koncie indywidualnym w dniu realizacji transferu, dokonywany pomiędzy kontami prowadzonymi dla różnych uczestników	OE	IN	ZN	GVUP	B
6.	Transfer pozycji zajętych w wyniku transakcji zarejestrowanej na danym koncie indywidualnym w dniu poprzedzającym dzień realizacji transferu, dokonywany pomiędzy kontami oznaczonymi różnymi indywidualnymi numerami klasyfikacyjnymi, prowadzonymi dla różnych uczestników	OE	IN	ZN		B
7.	Transfer pozycji zajętych w wyniku transakcji zawartej na podstawie zbiorczego zlecenia wystawionego przez zarządzającego portfelem na rachunek klientów, dla których zarządzający	OE	IN	ZN	BLOC	B

	realizuje jednakową strategię inwestycyjną, dokonywany z konta transakcyjnego na konto indywidualne klienta w przypadku, gdy konta te są prowadzone dla różnych uczestników					
8.	Transfer pozycji zajętych w wyniku transakcji zarejestrowanych na danym koncie indywidualnym w dniu poprzedzającym dzień realizacji transferu, dokonywany pomiędzy kontami oznaczonymi tym samym indywidualnym numerem klasyfikacyjnym, prowadzonymi dla różnych uczestników ¹	PT	IN	ZN		B
9.	Transfer pozycji zajętych w wyniku transakcji zarejestrowanych na danym koncie indywidualnym w dniu poprzedzającym dzień realizacji transferu, pomiędzy kontami oznaczonymi tym samym indywidualnym numerem klasyfikacyjnym, prowadzonymi dla tego samego uczestnika	PT	IN	ZN		N
10.	Rejestracja transferów zamykających pozycje w instrumentach pochodnych wykonywanych przez KDPW_CCP	RD	IN	ZN		N
11.	Rejestracja podziału pozycji w instrumentach pochodnych w związku ze zmianą standardu tych instrumentów	RK	IN	ZN		N
12.	Rejestracja transakcji pożyczki na zlecenie, której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem zabezpieczającym pożyczki na zlecenie	SECB SECL		PNEG		
13.	Rejestracja transakcji na rynku instrumentów pochodnych zawartej na rynku regulowanym organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A., której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem rozliczeniowym	TR	XG	ZG		N
14.	Rejestracja transakcji w instrumentach pochodnych (znaczny pakiet) zawartej na rynku regulowanym organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A., której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem rozliczeniowym	TR	XG	PG		N
15.	Rejestracja transakcji zawartej na rynku regulowanym organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A., której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem rozliczeniowym	TRAD	EXCH/ XWAR			N
16.	Rejestracja transakcji zawartej w alternatywnym systemie obrotu organizowanym przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A., której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem zabezpieczającym ASO	TRAD	EXCH/ XNCO			N
17.	Rejestracja transakcji zawartej na regulowanym rynku pozagiełdowym, której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem rozliczeniowym	TRAD	EXCH/ RPWC			N
18.	Rejestracja transakcji zawartej w alternatywnym systemie obrotu (innym niż elektroniczny rynek skarbowych papierów wartościowych zwany Treasury BondSpot Poland) organizowanym	TRAD	EXCH/ BOSP			N

	przez BondSpot SA, której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem zabezpieczającym ASO					
19.	Rejestracja transakcji zawartej na elektronicznym rynku skarbowych papierów wartościowych zwanym Treasury BondSpot Poland, będącym alternatywnym systemem obrotu organizowanym przez BondSpot SA, której rozliczenie jest zabezpieczone funduszem zabezpieczającym ASO	TRAD	EXCH/ TBSP			N
20.	Rejestracja transakcji związanej z wykonaniem instrumentów pochodnych zgodnie ze standardem tych instrumentów	OWNE	SECM /CCPX			N
21.	Rozliczenie opcji zgłoszonych do wykonania, związanych z wykonaniem opcji	XE	IN	ZN	KNOC	N
22.	Rozliczenie instrumentów pochodnych związanych z wygaśnięciem lub wykonaniem tych instrumentów	XP	XG	ZG		N
23.	Zgłoszenie wykonania jednostek indeksowych	ZS	IN	ZN		N

II. Objasnienia do oznaczeń stosowanych w systemie rozliczeń

1. TYPY INSTRUKCJI

- 1/ DN – instrukcja dostawy instrumentów finansowych (do zestawienia, dostawa niepłatna);
- 2/ PN – instrukcja przyjęcia instrumentów finansowych (do zestawienia, przejęcie niepłatne);
- 3/ ZP – instrukcja wystawiana przez KDPW_CCP do transakcji w instrumentach finansowych (z rozliczeniem pieniężnym);
- 4/ ZN – instrukcja wystawiana w instrumentach pochodnych przez KDPW_CCP.

2. TRYBY ZESTAWIENIA INSTRUKCJI

- 1/ B – instrukcja podlegająca zestawieniu z inną instrukcją;
- 2/ N – instrukcja niepodlegająca zestawieniu.

3. SYSTEMY ROZLICZEŃ

- 1/ MB – system sesyjny.

4. RODZAJ NALICZANIA POZYCJI

- 1/ GROS – rozliczenie brutto w papierach wartościowych (rozliczenie niepieniężne brutto);
- 2/ NETD – netting kierunkowy w papierach wartościowych (zagregowane rozliczenie niepieniężne);
- 3/ NETT – netting w papierach wartościowych (kompensacja świadczeń niepieniężnych);
- 4/ NOTD – netting kierunkowy w papierach wartościowych z badaniem progu opłacalności (zagregowane rozliczenie niepieniężne);
- 5/ NOTT – netting w papierach wartościowych z badaniem progu opłacalności (kompensacja świadczeń niepieniężnych);

5. KODY RYNKÓW

- 1/ EXCH/XNCO – alternatywny system obrotu organizowany przez Giełdę Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.;
- 2/ EXCH/BOSP – alternatywny system obrotu dłużnymi instrumentami finansowymi organizowany przez BondSpot S.A.;
- 3/ EXCH/RPWC – rynek regulowany pozagiełdowy;
- 4/ XG, EXCH/XWAR – rynek regulowany giełdowy;
- 5/ EXCH/TBSP – rynek Treasury BondSpot Poland organizowany przez BondSpot S.A.;
- 7/ SECM/CCPX – transakcje realizujące dostawę instrumentu bazowego w związku z wykonaniem instrumentów pochodnych;
- 8/ IN – inne.

6. TRYBY OBROTU

- 1/ PG – transakcje pakietowe zawierane w instrumentach pochodnych, których rozliczenie jest zabezpieczone funduszem rozliczeniowym;
- 2/ ZG, PNEG – transakcje zawierane w instrumentach finansowych, w obrocie wtórnym zorganizowanym, objęte funduszem rozliczeniowym, funduszem zabezpieczającym ASO albo

funduszem zabezpieczającym pożyczki na zlecenie, a także transakcje z nich wynikające, których rozliczenie objęte jest tym samym funduszem;

3/ ZN – operacje wykonywane w instrumentach pochodnych.

7. FAZY OPERACJI POŻYCZEK PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH

1/ OPEN – faza otwarcia operacji;

2/ CLOS – faza zamknięcia operacji.

8. FAZY OPERACJI DLA TRANSFERÓW POZYCJI I WYKONANIA INSTRUMENTÓW POCHODNYCH

1/ BLOC – transfer pozycji z konta transakcyjnego prowadzonego dla zarządzającego portfelem na rachunek klientów;

2/ GVUP – transfer pozycji zajętych w wyniku transakcji zarejestrowanej na danym koncie indywidualnym w dniu realizacji transferu, dokonywany pomiędzy kontami prowadzonymi dla różnych uczestników rozliczających (Give-up Take-up);

3/ KNOC – wykonanie opcji „przy cenie” i „poza ceną” od strony zgłaszającej wykonanie.

9. WSKAŹNIKI POZYCJI

1/ O – pozycja sprzedaży (pozycja krótka);

2/ C – pozycja kupna (pozycja długa).

10. FUNKCJE INSTRUKCJI

1/ NEWM – instrukcja rozliczeniowa,

2/ CANC – usunięcie instrukcji.

11. STATUS INSTRUKCJI

1/ CAND – instrukcja usunięta/odrzucona;

2/ PACK – potwierdzenie przyjęcia instrukcji/wprowadzenia zmiany przez KDPW_CCP;

3/ PEND – instrukcja przyjęta do KDPW_CCP;

4/ PENF – instrukcja oczekuje na akceptację/zestawienie/realizację w KDPW_CCP;

5/ SETL – zabezpieczenia zostały wniesione/zwolnione w KDPW_CCP;

6/ STLD – instrukcja rozliczona.

¹ Dotyczy również transferów pozycji z zabezpieczeniami wykonywanymi przez KDPW_CCP;

² W przypadku transferów pozycji w ramach jednej instytucji nie jest wymagane potwierdzenie warunków rozliczenia, o ile w instrukcji nie zostanie wskazany wymóg potwierdzenia.