

CCP/ZW/697/2024

SP/ZW/41/2024

Warszawa, 8 października 2024 r.

Uczestnicy KDPW

Uczestnicy KDPW_CCP

dot.: zmian w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP zaplanowanych na 2025 r.

Szanowni Państwo,

zgodnie z przyjętą od kilku lat praktyką, mającą na celu zwiększenie efektywności wdrożeń i umożliwienie Państwu zaplanowania zmian w systemach informatycznych z odpowiednim wyprzedzeniem, poniżej przedstawiamy informację o inicjatywach na 2025 r. związanych z modyfikacjami w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP, wynikających z rozwoju naszych usług lub z dostosowania do nowych regulacji, nowych systemów zewnętrznych.

W celu przybliżenia szczegółów związanych z planami na rok 2025 planujemy spotkanie z przedstawicielami organizacji zrzeszających uczestników, w tym w szczególności z przedstawicielami Rady Banków Depozytariuszy i Izby Domów Maklerskich, z przedstawicielami dostawców Państwa systemów informatycznych a także z uczestnikami, którzy nie należą do ww. stowarzyszeń. Spotkanie online odbędzie się **w dniu 30 października (środa) o g. 11:00** z użyciem MS Teams. Zaproszenie na spotkanie prześlemy odrębną wiadomością, po skompletowaniu danych o uczestnikach spotkania. W sprawach organizacyjnych, w tym w sprawie zgłoszenia udziału w spotkaniu, prosimy o kontakt na adres: bozena.koziorynski@kdpw.pl, do dnia 25 października br.

Po analizie zakresów i harmonogramów projektów, zgodnie z zasadą wprowadzania zmian systemowych w ramach okien wdrożeniowych, na **rok 2025** zaplanowaliśmy dwa terminy:

- wiosenne okno wdrożeniowe w terminie: **12-13 kwietnia**,
- jesienne okno wdrożeniowe w terminie: **22-23 listopada**.

Poniżej lista projektów związanych ze zmianami w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP, która może ulec modyfikacji w przypadku zmian otoczenia zewnętrznego, w szczególności regulacyjnego i nowych potrzeb biznesowych.

WIOSENNE OKNO WDROŻENIOWE_12-13 kwietnia 2025 r.

1. Wdrożenie nowej wersji standardu komunikatów FpML

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW_CCP (obróć OTC) – obligatoryjne

Mając na uwadze potrzebę zapewnienia najwyższej jakości usług oraz zgodności z międzynarodowymi standardami, w systemach KDPW_CCP zaplanowano zmianę standardu komunikatów Financial products Markup Language (FpML) z obecnie stosowanej wersji 5.11 na rekomendowaną przez International Swaps and Derivatives Association (ISDA) jako najnowszą, wersję 5.12. Nowa wersja standardu FpML zostanie wprowadzona w odpowiedzi na zmieniające się warunki rynkowe oraz w celu wsparcia planowanej usługi rozliczeń kontraktów Overnight Indexed Swaps (OIS) opartych na wskaźniku risk-free rate (RFR), które mogą zawierać dodatkowe charakterystyki niewystępujące w poprzednich wersjach. Implementacja wersji 5.12 jest kluczowa dla przyszłego rozwoju rynku finansowego i zapewnienia zgodności z międzynarodowymi regulacjami oraz trendami w rozliczaniu transakcji i w zarządzaniu ryzykiem.

Materiały: Szczegółowy materiał zawierający opis procesów, struktury oraz przykłady komunikatów Financial products Markup Language (FpML) oraz xml, przekazaliśmy Państwu **we wrześniu 2024 r.**

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z udziałem uczestników KDPW_CCP (obróć niezorganizowany) miało miejsce **we wrześniu 2024 r.** W środowisku testowym KDPW_CCP, uruchomiona została możliwość testowania procesów oraz przepływu ww. komunikatów, o czym informowaliśmy pismem CCP/ZW/605/2024 z dnia 5 września 2024 r.

Wdrożenie: Wdrożenie zmian w środowisku produkcyjnym planowane jest w dniach **12-13 kwietnia 2025 r.**

2. Wprowadzenie nowych komunikatów systemowych do pozyskiwania informacji o spreadach bid-ask dla instrumentów pochodnych OTC na potrzeby obliczeń depozytu add-on

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW_CCP (obróć OTC) – obligatoryjne

Dążąc do dostosowania do wymogów regulacyjnych i najlepszych praktyk rynkowych, KDPW_CCP wprowadzi zmiany w modelu obliczania depozytów zabezpieczających w obrocie niezorganizowanym (OTC) polegające m.in. na uwzględnieniu obliczeń depozytu add-on na ryzyko płynności i koncentracji. Obliczenia tych depozytów oparte są m.in. na danych o wysokości spreadów bid-ask na wybrane instrumenty finansowe i ich nominały, które będą pozyskiwane od uczestników rozliczających i wymieniane przy pomocy nowych komunikatów systemowych.

Materiały: Szczegółowy materiał opisujący zmiany w modelu obliczeń depozytów zabezpieczających w obrocie niezorganizowanym zostanie przekazany do uczestników rozliczających **do dnia 15 października 2024 r.** Szczegółowy opis komunikatów zamieszczony jest w zakładce *Nowe komunikaty planowane w związku z obsługą ankiet LCRM* na stronie internetowej www.kdpwccp.pl ([link](#)).

Testy: Aktualnie KDPW_CCP prowadzi testy akceptacyjne nowych rozwiązań, po ich zakończeniu, **w listopadzie 2024 r.**, prześlemy informację o gotowości rozpoczęcia testów z udziałem uczestników.

Wdrożenie: Wdrożenie zmian w środowisku produkcyjnym planowane jest w dniach **12-13 kwietnia 2025 r.**

3. Implementacja nowych rozwiązań w zakresie obsługi WZ

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW – obligatoryjne

W Grupie KDPW, w 2025 r. kontynuowane będą prace projektowe mające na celu rozszerzenie zakresu usługi Walne Zgromadzenia (WZ). W ramach wiosennego okna wdrożone zostaną zmiany anonsowane pismem BRB/ZW/9/2024 z dnia 26 kwietnia 2024 r., dotyczące komunikatu ISO 20022 seev.001.001.11 (MeetingNotification), polegające w szczególności na wprowadzeniu nowego oznaczenia metody udziału w walnym zgromadzeniu „VIRT”, które będzie stosowane w przypadku udostępnienia przez spółkę możliwości udziału w walnym zgromadzeniu za pośrednictwem aplikacji eVoting. Ponadto zmiany dotyczą wprowadzenia obsługi opcjonalnych elementów ww. komunikatu, mających zastosowanie w przypadku walnych zgromadzeń spółek zagranicznych.

Materiały: Szczegółowe materiały (uzupełniające informacje przekazane w piśmie [BRB/ZW/9/2024](#)) zostaną przekazane w **grudniu 2024 r.**

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy w **lutym 2025 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie zmian w środowisku produkcyjnym planowane jest w dniach **12-13 kwietnia 2025 r.**

JESIENNE OKNO WDROŻENIOWE_22-23 listopada 2025 r.

4. Aktualizacja wersji komunikatów ISO 20022 z obszarów: WZ i identyfikacja akcjonariuszy

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW – obligatoryjne

Mając na uwadze standaryzację obsługiwanych przez KDPW procesów zgodnie z międzynarodowymi standardami oraz zapewnienie zgodności z wymogami regulacyjnymi dot. stosowania formatów elektronicznych, umożliwiających interoperacyjność i przetwarzanie bezpośrednio, w listopadzie 2025 r. planowana jest aktualizacja komunikatów ISO 20022 z obszaru WZ oraz identyfikacji akcjonariuszy, do wersji wymaganej przez SWIFT (jako element strategicznych działań związanych z dostosowaniem do zmian wersji komunikatów w ramach systemu ECB SCoRE).

Materiały: Szczegółowe materiały dotyczące projektowanych zmian w systemach informatycznych KDPW, planujemy przekazać Państwu **do końca maja 2025 r.**

Testy: Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów z Państwa udziałem przewidujemy **od września 2025 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie zmian planowane jest w terminie **22 - 23 listopada 2025 r.**

INNE WAŻNE PROJEKTY, PLANOWANE DO WDROŻENIA W ROKU 2025

(poza planowanymi oknami wdrożeniowymi), mające wpływ na Państwa systemy informatyczne:

5. Dostosowanie GK KDPW do systemu SORBNET3

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obligatoryjne

Prowadzone w Grupie KDPW prace dostosowawcze do nowego, projektowanego przez NBP systemu SORBNET3 (S3) mają na celu zapewnienie kontynuacji realizowania rozliczeń i rozrachunku pieniężnego w banku centralnym dla waluty PLN.

Dodatkowo GK KDPW rozwija swój profil prowadzenia działalności o nowe funkcjonalności oferowane wraz z wdrożeniem nowego systemu, między innymi o możliwości posiadania w S3 wielu rachunków. W przypadku banków pełniących funkcję banku płatnika, wielorachunkowość umożliwi zwiększenie elastyczności w zakresie ustanawianych relacji uczestników bezpośrednich KDPW i KDPW_CCP nieposiadających rachunków bankowych w NBP na potrzeby operacji wykonywanych przez GK KDPW. W ramach dostosowań do SORBNET3 w systemach informatycznych GK KDPW wprowadzone zostaną niezbędne zmiany m.in. w zakresie obsługi rozliczeń i rozrachunku transakcji w PLN, wypłat świadczeń z papierów wartościowych w PLN oraz dokonywania rozrachunku w PLN pozostałych operacji oraz zarządzania środkami systemu gwarantowania rozliczeń.

Materiały: Szczegółowe materiały, w tym wszelkie informacje dotyczące realizacji kolejnych etapów prac projektowych, przekazujemy Państwu w ramach korespondencji, która dostępna jest również na naszych stronach internetowych:

- w obszarze zagadnień KDPW pod [linkiem](#),
- w obszarze zagadnień KDPW_CCP pod [linkiem](#).

Testy: Poza obowiązkowym zestawem testów wymaganych przez NBP, **w pierwszej połowie grudnia 2024 r.** GK KDPW planuje rozpocząć testy z udziałem uczestników KDPW i KDPW_CCP.

Wdrożenie: Uruchomienie systemu SORBNET3, zgodnie z harmonogramem NBP – planowane jest na dzień **9 czerwca 2025 r.**

6. Dostosowanie systemów GK KDPW do nowego systemu transakcyjnego WATS

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obligatoryjne

W Grupie Kapitałowej KDPW prowadzony jest projekt mający na celu dostosowanie systemów GK KDPW (głównie systemu kdpw_stream) do nowego systemu transakcyjnego WATS. **Harmonogram prac projektowych po stronie GK KDPW jest zależny od harmonogramu projektu WATS.**

Z perspektywy zmian koniecznych do wprowadzenia po Państwa stronie, zidentyfikowaliśmy potrzebę zmian w obszarze komunikatów ISO20022 Securities Clearing (secl), które polegają na:

- aktualizacji do obowiązującej obecnie wersji standardu Clearing 3.0,
- dodaniu standardowej koperty komunikacyjnej GK KDPW stosowanej dla innych grup komunikatów ISO, a także
- poszerzeniu zawartości informacyjnej komunikatów do wymogów systemu WATS.

Materiały: Szczegółowe materiały dot. zmian w komunikatach ISO20022 z obszaru Securities Clearing (secl) przekazaliśmy Państwu oraz opublikowaliśmy na stronie internetowej KDPW_CCP ([link](#)) **w marcu 2023 r.**

Testy: Podłączenie systemów GK KDPW do środowiska testowego GPW eUAT oraz środowiska GPW prePROD odbywa się w terminach wynikających z harmonogramu wdrożenia GPW WATS. Nowe wersje komunikatów ISO20022 z obszaru Securities Clearing (secl) udostępniemy w środowisku testowym **w listopadzie 2024 r.**

Wdrożenie: Wdrożenie nowych wersji komunikatów (secl) nastąpi łącznie z wdrożeniem nowego systemu WATS, które zgodnie z obecnym harmonogramem planowane jest na dzień **10 listopada 2025 r.**

7. Zmiany w obszarze połączeń komunikacyjnych pomiędzy systemami informatycznymi GK KDPW a systemami uczestników

dostosowanie systemów informatycznych uczestników KDPW i KDPW_CCP – obligatoryjne

Grupa KDPW stale rozwija swoje usługi dbając o ich bezpieczeństwo cybernetyczne i konsekwentnie realizuje działania na rzecz podnoszenia poziomu niezawodności i bezpieczeństwa systemów IT.

Mając powyższe na uwadze, z początkiem 2025 r. GK KDPW przeprowadzi istotne zmiany w obszarze połączeń komunikacyjnych pomiędzy systemami informatycznymi GK KDPW a uczestnikami poszczególnych usług GK KDPW. Wprowadzone zmiany obejmą zarówno komunikację w ramach modelu A2A, jak i U2A.

7.1 Modernizacja obsługi certyfikatów dostępowych w obszarze komunikacji A2A

GK KDPW w 2025 r. finalizować będzie projekt w zakresie modernizacji komunikacji A2A w obszarze dotyczącym usług dla uczestników bezpośrednich KDPW (w tym także w ramach usług ARM oraz Systemu Rekompensat) oraz uczestników rozliczających KDPW_CCP. Na poziomie GK KDPW wprowadzona została separacja w zakresie uwierzytelniania się do komunikacji MQ w KDPW oraz KDPW_CCP, co wiąże się z koniecznością wystąpienia o odrębny certyfikat do ustanowienia komunikacji A2A z KDPW_CCP. W związku z przyjętym podziałem wprowadzona zostanie także nowa, odrębna względem obecnego ESDK, adresacja sieciowa, co wymagać będzie ustanowienia odpowiednich dostępów w ramach infrastruktury sieciowej. W konsekwencji, komunikaty wymieniane z KDPW oraz z KDPW_CCP będą wymagały odrębnego połączenia do właściwych kolejek MQ.

Materiały: Szczegółowe materiały dot. planowanych zmian, w tym specyfikację konfiguracji MQ w komunikacji A2A, instrukcje i opis procesu wdrożenia zmian w komunikacji A2A, przekazaliśmy Państwu **w lutym 2024 r.** Wszystkie informacje w tym zakresie znajdziecie Państwo również na naszej stronie www.kdpw.pl ([link](#)).

Informacje o terminach okien przełączeniowych będziemy przekazywać Państwu w odrębnej korespondencji **w pierwszej połowie listopada 2024 r.** Także w listopadzie 2024 r. planujemy umożliwić Państwu możliwość weryfikacji połączeń sieciowych z KDPW i KDPW_CCP.

Wdrożenie: Wprowadzanie zmian nastąpi w ramach okien przełączeniowych rozplanowanych na **I kwartał 2025 r.**

7.2 Uruchomienie w Portalu usług GK KDPW nowych aplikacji dla uczestników

Na początek 2025 r. zaplanowane zostało również wdrożenie zmian w komunikacji elektronicznej z uczestnikami bezpośrednimi KDPW i uczestnikami rozliczającymi KDPW_CCP w obszarze U2A. Uczestnikom zostaną udostępnione nowe aplikacje internetowe w Portalu usług <https://online.kdpw.pl>:

- aplikacja *Usługi CSD – Uczestnik bezpośredni*, do obsługi komunikacji w ramach usług depozytowych, w tym poprzez komunikaty systemowe oraz
- aplikacje: *Korespondencja KDPW* i *Korespondencja KDPW_CCP*, do komunikacji w postaci plików nieustrukturyzowanych.

WAŻNE! W następstwie uruchomienia z początkiem 2025 r. w Portalu usług GK KDPW nowych ww. aplikacji oraz przejściem przez te aplikacje funkcji wymiany danych (komunikatów systemowych i korespondencji) –

obecnie funkcjonujący kanał komunikacji U2A - **ESDI/Web**, zostanie z **końcem I kwartału 2025 r. wyłączony z użytkowania**.

Materiały: Szczegółowe materiały dot. uruchomienia nowych aplikacji oraz funkcjonowania dotychczasowych i nowych rozwiązań w okresie przejściowym, przekazemy Państwu na przełomie **października/listopada 2024 r.**

Wdrożenie: Uwzględniając potrzebę dostosowań organizacyjno-technicznych po Państwa stronie, przewidujemy, że w okresie przejściowym, tj. **w I kwartale 2025 r.**, funkcjonować będą równoległe dwa kanały komunikacji U2A: ESDI/Web oraz nowe aplikacje w Portalu usług zawierające funkcje wymiany danych (komunikatów systemowych i korespondencji).

Ponadto, pragniemy poinformować, że mając na uwadze przyjęte kierunki strategiczne, naszym długofalowym celem w obszarze standaryzacji komunikacji, jest ujednoczenie stosowania komunikatów w zakresie rozrachunku do standardu opartego o normę ISO 20022.

Tym samym w 2027 r. planujemy odejście od stosowania komunikatów MTxxx (zgodnych z normą ISO 15022) w obszarze rozrachunków, a następnie wprowadzenie wymogu stosowania komunikatów zgodnych z ISO 20022 w miejsce obowiązujących obecnie tzw. komunikatów własnych.

Więcej informacji na temat naszych planów w tym zakresie przekazemy Państwu **w II połowie 2025 r.**

Z poważaniem

Maciej Trybuchowski
Prezes Zarządu

Marcin Truchanowicz
Członek Zarządu

Do wiadomości:

Narodowy Bank Polski
Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.
BondSpot S.A.
Izba Domów Maklerskich
Rada Banków Depozytariuszy przy ZBP
Urząd Komisji Nadzoru Finansowego