

CCP/ZW/ 290 /2022

Warszawa, 13 kwietnia 2022 r.

Uczestnicy KDPW\_CCP  
(obrot zorganizowany)  
(obrot niezorganizowany)**dot.: wdrożeń w dniach 23-24 kwietnia 2022 r. w systemach informatycznych KDPW\_CCP w ramach wiosennego okna wdrożeniowego**

Szanowni Państwo,

nawiązując do wcześniejszej korespondencji (sygn. CCP/ZW/622/2021 i SCP/ZW/8/2021 z dnia 30 września 2021 r.) zawierającej informacje o planach na rok 2022 związanych ze zmianami w systemach informatycznych KDPW i KDPW\_CCP wynikających ze zmian w zakresie świadczonych usług lub zmian regulacyjnych, uprzejmie informujemy, że w dniach **23-24 kwietnia 2022 r.** w ramach wiosennego okna wdrożeniowego 2022, nastąpi implementacja:

- narzędzi wspierających rozliczenia transakcji repo zawartych na TBSP,
- zmian w obsłudze odkupu papierów wartościowych,
- zmian w zarządzaniu ryzykiem w KDPW\_CCP.

**1. Uruchomienie rozliczania przez KDPW\_CCP transakcji repo zawartych na TBSP.**

Od 25 kwietnia 2022 r. KDPW\_CCP rozpoczyna świadczenie nowej usługi - rozliczania transakcji warunkowych (repo) zawartych na platformie Treasury BondSpot Poland. KDPW\_CCP będzie przyjmował do rozliczenia klasyczne transakcje repo, których przedmiotem są skarbowe papiery wartościowe (SPW) rejestrowane w Krajowym Depozycie Papierów Wartościowych, z wyłączeniem obligacji indeksowanych, wg listy publikowanej przez BondSpot.

Informacje dotyczące warunków zawierania, rozliczenia i rozrachunku transakcji repo zawartych na TBSP, szczegóły dotyczące komunikatów postrozliczeniowych, a także informacje dot. raportowania transakcji do repozytorium zgodnie z SFTR oraz informacje o opłatach rozliczeniowych, prezentowaliśmy Państwu w przesyłanych materiałach oraz podczas spotkań. Wszystkie materiały, w tym informacje dotyczące zmiany komunikatów systemu kdpw\_stream dostępne są na stronie internetowej KDPW\_CCP w zakładce [Rozliczanie transakcji repo na TBSP](#).

### Sprawozdawczość SFTR

Zakres raportowania KDPW\_CCP do repozytorium transakcji KDPW obejmie wszystkie transakcje repo rozliczane przez KDPW\_CCP zawarte w obrocie zorganizowanym. Szczegóły dotyczące zgłaszania transakcji repo zostały opisane w [Handbook](#)-u opublikowanym na stronie internetowej KDPW\_CCP.

### Testy

W dniu 22 listopada 2021 r. udostępniliśmy środowisko testowe oraz rozpoczęliśmy testy z Państwa udziałem w zakresie rozliczeń i zabezpieczania transakcji warunkowych repo zawieranych na TBSP, a także w zakresie raportowania ww. transakcji do repozytorium transakcji KDPW/SFTR.

### Regulacje KDPW\_CCP

W dniu 11 kwietnia 2022 r. opublikowane zostały zmiany w regulacjach KDPW\_CCP w zakresie rozpoczęcia rozliczeń transakcji warunkowych repo w obrocie zorganizowanym wraz z objaśnieniami zawartymi w piśmie nr [CCP/ZW/282/2022](#).

## 2. Wdrożenie zmian w obsłudze odkupu papierów wartościowych.

Od dnia 25 kwietnia 2022 r. KDPW\_CCP udostępni w aplikacji GUI funkcjonalność odkupu papierów wartościowych (zakup na otwartym rynku) i przeprowadzania aukcji dla repo. Nowa funkcjonalność „Aukcje” dostępna będzie poprzez Portal Usług KDPW <https://online.kdpw.pl/> w serwisie „Podstawowe usługi KDPW\_CCP”, a skorzystanie z niej wymagać będzie podpisania nowego Porozumienia – dostarczenia nowych wniosków dostępowych do aplikacji GUI ([wzór nr 35](#)).

Więcej informacji na temat aplikacji GUI, w tym dostępnych funkcji oraz warunków dostępu do aplikacji znajdziecie Państwo w zakładce [Aplikacja GUI](#).

### Testy

Zachęcamy Państwa do testowania nowej funkcjonalności. Dostęp testowy można uzyskać, wysyłając zgłoszenie na adres: [ccp@kdpw.pl](mailto:ccp@kdpw.pl).

### Regulacje KDPW\_CCP

W dniu 11 kwietnia 2022 r. przekazaliśmy Państwu pismem CCP/ZW/280/2022 szczegółowe informacje dot. procesu podpisywania nowych porozumień poprzez złożenie wniosków dostępowych do GUI.

## 3. Wdrożenie zmian w modelu obliczeń depozytów zabezpieczających w związku z wprowadzeniem depozytów dodatkowych, tzw. depozytów add-on.

Od 25 kwietnia 2022 r. KDPW\_CCP wdroży nowy model zarządzania ryzykiem, poszerzony o dodatkowe depozyty add-on zabezpieczające ryzyko płynności i koncentracji oraz ryzyko korelacji. Szczegółowe informacje o planowanych zmianach w modelu obliczeń depozytów zabezpieczających w związku z wprowadzeniem depozytów add-on przekazaliśmy Państwu w materiałach informacyjnych, które wraz z kompletną dokumentacją uwzględniającą struktury komunikatów systemowych, dostępne są na stronie internetowej KDPW\_CCP w zakładce [Uczestnicy/Obrót zorganizowany/Zmiany komunikatów](#).

### Testy

Środowisko testowe udostępniliśmy Państwu w listopadzie 2020 r., a od lipca 2021 r. funkcjonuje oprogramowanie zawierające pełne rozwiązanie.

Regulacje KDPW\_CCP

W piśmie nr [CCP/ZW/282/2022](#) z dnia 11 kwietnia 2022 r. opublikowane zostały zmiany w regulacjach KDPW\_CCP dotyczące również wprowadzenia zmian w modelu obliczeń depozytów zabezpieczających.

W przypadku pytań prosimy o kontakt mailowy na adres [ccp@kdpw.pl](mailto:ccp@kdpw.pl).

Z poważaniem,

Maciej Trybuchowski  
Prezes Zarządu

Sławomir Panasiuk  
Wiceprezes Zarządu

Do wiadomości:

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