
Zmiany w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP w 2022 r.

Spotkanie z uczestnikami

8 listopada 2021 r.

01
Wprowadzenie

Prezes Maciej Trybuchowski

02
Dostosowanie do wymogów rozporządzenia CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku (II etap)

03
Uruchomienie usługi rozliczeń transakcji warunkowych (repo) w segmencie rynku ASO dla obrotu zorganizowanego

04
Wprowadzenie depozytów dodatkowych, tzw. depozytów add-on

05
Włączenie rozliczeń i zarządzania ryzykiem dla transakcji OTC do systemu kdpw_stream

06
Uruchomienie nowych funkcji Portalu danych Grupy KDPW

07
Uruchomienie systemu uwierzytelniania dwuskładnikowego (MFA)

08
Portal online.kdpw.pl – uruchomienie nowych aplikacji

09
Target Services, MyStandards, AmiSeco

1 lutego

Zimowe okno wdrożeniowe

- Wdrożenie funkcjonalności w zakresie **dyscypliny rozrachunku** (etap II): system kar pieniężnych, zmiany dotyczące operacji buy-in, hold-release)

23-24 kwietnia

Wiosenne okno wdrożeniowe

- Uruchomienie usługi rozliczania transakcji **repo** zawartych na platformie Treasury BondSpot Poland
- Wdrożenie depozytów **add-on** zabezpieczających ryzyko płynności i koncentracji oraz ryzyko korelacji

22-23 października

Jesienne okno wdrożeniowe

- Włączenie rozliczeń i zarządzania ryzykiem dla transakcji **OTC** do systemu kdpw_stream



02

Dostosowanie do wymogów rozporządzenia CSDR w zakresie dyscypliny rozrachunku (II etap)

Krzysztof Ołdak, Żaneta Skorupska-Świrska



STAN OBECNY - WYMOGI DOTYCZĄCE TERMINU WDROŻENIA

- RTS 2018/1229 – pierwotnie wyznaczony termin wejścia w życie (13 września 2020 r.) oficjalnie przesunięty na 1 lutego 2021 r. (Rozporządzenie 2020/1212 z 8.05.2020 r.), a następnie przesunięty na 1 lutego 2022 r. (Rozporządzenie 2021/70 z 23.10.2021 r.)
- System kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek – wdrożenie 1 lutego 2022 r.

Ważne! Rekomendacja ESMA w zakresie opóźnienia wdrożenia regulacji dotyczących obowiązkowego stosowania operacji buy-in, opublikowana w dniu 23 października 2021 r.



PRACE WDROŻENIOWE W KDPW - ETAPOWANIE

- Ustalenia z 2020 r. dotyczące realizacji wdrożeń w dwóch etapach:
 - etap I - zmiany/dostosowania w zakresie niektórych funkcjonalności wspomagających rozrachunek,
 - etap II - wszystkie pozostałe funkcjonalności, a przede wszystkim wdrożenia nowego systemu naliczania kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek oraz zmiany w obszarze mechanizmu hold-release.
- **I etap (19 kwietnia 2021 r. - wiosenne okno wdrożeniowe)** objął zmiany w następujących funkcjonalnościach:
 - Tolerance level
 - Odwoływanie zleceń rozrachunku
 - Rozrachunek w częściach
 - Obsługa w zleceniu rozrachunku pola „Place of clearing”



II ETAP PRAC – LUTY 2022 R.

Zakres wdrożenia:

- Mechanizmy dot. systemu kar pieniężnych
- Zmiany w mechanizmie hold-release

- Obsługa operacji buy-in
- Zmiany w przetwarzaniu instrukcji dot. rozrachunków posttransakcyjnych

Termin wdrożenia zgodnie z RTS – **1 lutego 2022 r.**

Rozpoczęcie testów zewnętrznych – **25 października 2021 r.**



NOWY SYSTEMU KAR PIENIĘŻNYCH – PODSTAWOWE ZAŁOŻENIA (1)

Kary pieniężne dotyczą przypadków nieterminowego rozrachunku z powodu:

- Brak aktywów na koncie uczestnika w dniu planowanego rozrachunku
- Ustanowienie stanu hold (wstrzymanie rozrachunku)
- Wprowadzenie instrukcji po dacie planowanego rozrachunku

Instrukcje podlegające karom:

- Zestawione, oczekujące na rozrachunek
- Niezależnie od rodzaju rynku, którego dotyczą, w tym OTC
- DvP oraz FoP

Wyjątki:

- Operacje nie związane ze zmianą własności
- Instrukcje dot. zdarzeń korporacyjnych
- Instrukcje techniczne



NOWY SYSTEMU KAR PIENIĘŻNYCH – PODSTAWOWE ZAŁOŻENIA (2)

Instrumenty podlegające systemowi kar pieniężnych:

- Dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym lub do systemu obrotu lub
- Objęte rozliczeniami prowadzonymi przez CCP

Wysokość kary uzależniona od wartości papierów wartościowych wyliczanej wg. „wspólnych” zasad

Stawki kar pieniężnych – określone w RTS 2017/389

Waluta naliczanych w KDPW kar pieniężnych – PLN lub EUR

Transakcje z udziałem CCP jako partnera centralnego:

- Raportowanie do uczestników KDPW
- Pobór i redystrybucja kar przez CCP w relacji do uczestników rozliczających.

NOWY SYSTEMU KAR PIENIĘŻNYCH - RAPORTOWANIE ORAZ POBÓR/REDYSTRYBUCJA KAR PIENIĘŻNYCH

- KDPW przekazuje do uczestników raporty zgodne z normą ISO 20022
- Raporty dzienne i miesięczne – **semt.044.001.01**

Raporty dzienne:

- Odrębne dla nowych kar i modyfikacji
- Generowanie raportu „no activity” wskazującego na brak kar
- Szczegółowe informacje analityczne
- Wysyłka po zamknięciu procesu naliczania kar – najpóźniej do g.12.00 dnia następnego

Raporty miesięczne:

- Przekazywane po zakończeniu miesiąca kalendarzowego – w 14 dniu roboczym
- Dane zagregowane

Pobór i redystrybucja kar pieniężnych:

- Płatności opiewające na globalne kwoty netto
- Realizacja w 17 dniu roboczym, godz.11.00
- Model oparty na instrukcjach PFOD (payment free of delivery)
- Płatności dokonywane w SORBNET2 (dla PLN) lub Target2 (dla EUR)
- KDPW inicjuje zlecenia poboru i redystrybucji kar w banku rozliczeniowym.



NOWY SYSTEM KAR PIENIĘŻNYCH – ZMIANY W TABELI OPŁAT KDPW

Kary pieniężne za nieterminowy rozrachunek nie mogą stanowić źródła przychodów dla CSD

Obecna opłata za spowodowanie zawieszenia rozrachunku (pkt 8.1 Tabeli opłat) – **skreślenie**

Nowe opłaty z tytułu obsługi mechanizmu kar pieniężnych – w trakcie procesu zatwierdzenia:

- Opłata miesięczna
- Naliczana odrębnie od każdego rodzaju działalności uczestnika
- W pełnej wysokości niezależnie od czasu trwania umowy o uczestnictwo w danym miesiącu
- Stawki opłat zależne od rodzaju działalności uczestnika:
 - Działalność maklerska i powiernicza – opłata 800 zł /miesiąc
 - Pozostałe rodzaje działalności – opłata 250 zł / miesiąc



ZMIANY W MECHANIZMIE HOLD-RELEASE

- Rozszerzenie możliwości przechodzenia ze stanu „release” na „hold” również w ramach systemu sesyjnego – obecnie jest to możliwe wyłącznie w systemie RTGS
- Możliwość wprowadzenie w stan „hold” instrukcji już częściowo rozrachowanych na skutek zastosowania mechanizmu rozrachunku w częściach
- Nie przewiduje się wprowadzania rozwiązania umożliwiającego wprowadzenie w stan „hold” wskazanej części wolumenu określonego w zleceniu rozrachunku (tzw. partial hold)
- Stosowanie mechanizmu hold-release na potrzeby procedury odkupu (buy-in):
 - instrukcje podlegają procesowi zestawiania – mechanizm hold-release może stosować każda ze stron rozrachunku (model obowiązujący obecnie)
 - instrukcje przekazywane przez CCP (gwarantowane) – mechanizm hold-release może stosować wyłącznie CCP, będący wystawcą tej instrukcji
 - instrukcje nie podlegając procesowi zestawiania, dotyczące transakcji niegwarantowanych (np. transakcje pakietowe) – mechanizm hold-release może stosować każda ze stron rozrachunku



MECHANIZMY NA POTRZEBY OPERACJI BUY-IN

- KDPW będzie oferować mechanizmy, które umożliwią uczestnikom realizację/rozrachunek operacji buy-in oraz umożliwią odpowiednie zarządzanie instrukcjami rozrachunku, których nieterminowy rozrachunek spowodował inicjację procesu buy-in:
 - mechanizm hold-release
 - mechanizm odwoływania instrukcji rozrachunku
 - rozrachunek w częściach, w tym wykorzystanie mechanizmu zmiany zgody na rozrachunek w częściach w instrukcji rozrachunku
 - Przewiduje się nowe oznaczenie kodowe operacji buy-in zawartych poza obrotem zorganizowanym: kod operacji TRAD, tryb obrotu BISO, instrukcje podlegające procesowi zestawiania
- Raportowanie o transakcjach buy-in – zgodne z normą ISO 20022;
- komunikaty sese.041.001.01 i sese.042.001.01



ZMIANY W PRZETWARZANIU INSTRUKCJI DOT. ROZRACHUNKÓW POSTTRANSAKCYJNYCH

- Efekt dyskusji prowadzonych w przeszłości, mających na celu usprawnienie przetwarzania instrukcji przekazywanych przez klientów uczestników – ograniczenie stosowania w instrukcjach rozrachunku kodu związanego z rozrachunkiem posttransakcyjnym (w systemie KDPW kod rynku XPXX)
- Implementacja rozwiązania „neutralnego”:
 - pozostanie możliwość wskazania kodu rynku KDPW/XPXX dla operacji z kodem TRAD
 - wskazanie tego szczególnego kodu rynku będzie obsługiwane indywidualnie z perspektywy procesu zestawiania:
 - zgodne wskazanie z obu stron – zestawienie instrukcji
 - różne wskazanie kodu rynku z obu stron – brak zestawienia
 - wskazanie przez jedną stronę i brak wskazania z drugiej strony – zestawienie instrukcji
 - wynikowe dowody ewidencyjne powstałe po zestawieniu instrukcji uczestników przestają być identyfikowane w systemie KDPW jako tzw. rozrachunki posttransakcyjne - kod rynku KDPW/XPXX nie będzie „przenoszony”
 - obecne rozrachunki posttransakcyjne będą interpretowane w systemie KDPW jako operacje poza systemem obrotu, w efekcie będą podlegały rozrachunkom w tych samych dniach, w których są dokonywane rozrachunki operacji dot. transakcji OTC.

FUNKCJONALNOŚCI WDRAŻANE W KDPW_CCP:

- moduł obsługi kar pieniężnych za nieterminowy rozrachunek – pobranie i redystrybucja naliczonych kwot do kontrahentów KDPW_CCP (zlecenia z kodem 644 w Sorbnet2/Target2);
- implementacja zasad wyceny papierów wartościowych na potrzeby mechanizmu kar pieniężnych (zasady wspólne dla GK KDPW);
- mechanizmy monitoringu uczestników w zakresie terminowości rozrachunku;
- wspomaganie procesu odkupu papierów na otwartym rynku (buy-in) - moduł aukcji oraz system rekompensat pieniężnych (zlecenia z kodem 645 w Sorbnet2/Target2);
- zgodne z CSDR zmiany w mechanizmie hold-release – wstrzymywanie i anulowanie rozrachunku instrukcji powodujących zawieszenia rozrachunku, wystawionych przez KDPW_CCP;
- udostępnienie UR KDPW_CCP informacji o procedurze buy-in przez KDPW_CCP (rozszerzenie komunikatów ISO20022).

Udostępnienie UR KDPW_CCP informacji o procedurze buy-in przez KDPW_CCP (komunikaty ISO20022):

- secl.007.001.02 – powiadomienie o przystąpieniu przez KDPW_CCP do procedury, instrukcje powodujące zawieszenia rozrachunku przechodzą w stan HOLD;
- secl.009.001.02 – informacja o statusie realizacji procedury, dokonaniu odkupu, zwrot różnicy w cenie, wysokości rekompensaty pieniężnej wraz z terminem realizacji płatności;
- pozostałe komunikaty są bez zmian;
- struktury komunikatów ISO20022 z kolekcji wykorzystywanej przez KDPW_CCP umieszczone są na platformie MyStandards (po zalogowaniu).

Testy z uczestnikami KDPW_CCP:

- możliwa realizacja założonych scenariuszy testowych, kontakt ccp@kdpw.pl
- optymalne rozwiązanie – wszyscy UR KDPW_CCP wezmą udział w testach: zawieszenie rozrachunku powyższej 4 dni, powiadomienie o procedurze buy-in, instrukcje w stanie HOLD, aukcja, informacja o statusie realizacji procedury buy-in, obsługa rozrachunku, częściowego rozrachunku i przypadku z wyłączną wypłatą rekompensaty.



	HARMONOGRAM
10 czerwca 2020 23 kwietnia 2021 9 lipca 2021 2 sierpnia 2021 29 września 2021	Szczegółowe informacje dotyczące zakresu dostosowań zostały przekazane w materiałach informacyjnych (pisma: nr DO/ZW/568/2020 z dnia 10 czerwca 2020 r., nr DO/ZW/688/2021 z dnia 23 kwietnia 2021 r., nr DO/ZW/1229/2021 z dnia 2 sierpnia 2021 r. oraz nr DO/ZW/1505/2021 z dnia 29 września 2021 r., a także nr CCP/ZW/486/2021 z dnia 9 lipca 2021 r.). Ponadto struktury komunikatów ISO 20022 z kolekcji wykorzystywanej przez KDPW i KDPW_CCP umieszczone są na platformie MyStandards
25 października 2021	Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów
grudzień 2021/styczeń 2022	Planowane testy na danych produkcyjnych
1 lutego 2022	wdrożenie funkcjonalności w zakresie dyscypliny rozrachunku (etap II): system kar pieniężnych, zmiany dotyczące operacji buy-in, w tym aukcje dla buy-in, hold-release

Pytania i odpowiedzi



03

Uruchomienie usługi rozliczeń transakcji warunkowych (repo) w segmencie rynku ASO dla obrotu zorganizowanego

Marcin Truchanowicz

TRANSAKCJA REPO

- **Klasyczne REPO** - skarbowe papiery wartościowe (SPW) dopuszczone do obrotu na Treasury BondSpot Poland (TBSP), z wyłączeniem obligacji indeksowanych. Otwarcie i zamknięcie REPO odbywa się na tej samej obligacji (jeden kod ISIN).
- **Transakcja REPO** - objęta systemem gwarantowania rozliczeń KDPW_CCP od momentu przyjęcia jej do systemu rozliczeń KDPW_CCP.
- TBSP przekazuje w dniu zawarcia transakcji do rozliczenia w KDPW_CCP obie nogi transakcji REPO tj. transakcję otwierającą i zamykającą.
- Transakcje są zawierane na TBSP z zachowaniem anonimowości.



Daty rozrachunku transakcji otwierającej i zamykającej:

- ✓ data rozrachunku transakcji otwierającej: [T+0; T+2],
- ✓ data rozrachunku transakcji zamykającej (data odkupu): [T+1; T+365].

- Kupon w dniu jego płatności jest wymagany od strony kupującej obligacje w transakcji otwierającej i przekazywany za pośrednictwem KDPW_CCP stronie sprzedającej.

ROZLICZENIE TRANSAKCJI – zasady ogólne

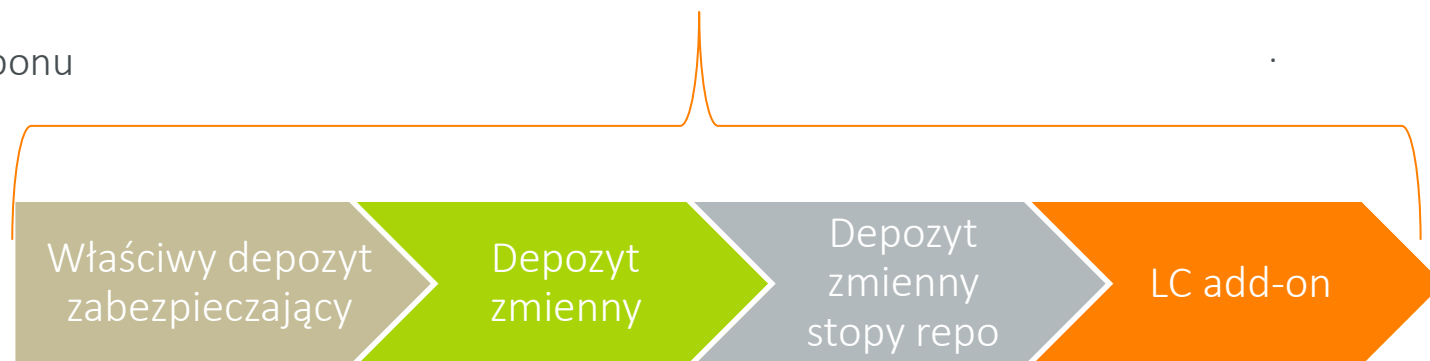
- Każdego dnia, w którym zawarte są transakcje, tworzone są pozycje rozliczeniowe na bazie atrybutów konta rozliczeniowego, papieru wartościowego, daty transakcji, daty rozrachunku, kodu rynku, kodu operacji.
- Transakcje REPO, REVERSE-REPO oraz OUTRIGHT posiadają odrębne kody operacji rozrachunkowych ISO.
- Bazując na pozycjach rozliczeniowych dla wszystkich transakcji REPO, REVERSE-REPO oraz OUTRIGHT tworzone są odrębne instrukcje rozrachunku do KDPW na bazie brutto.
- Okres zatrzymania transakcji w systemie rozliczeń (np. 30 min) przed przekazaniem instrukcji do KDPW (MB).
- Graniczny termin zawarcia transakcji T+0 – godzina 14:50. Ostatni możliwy termin biorąc pod uwagę ostatnią sesję rozrachunkową MB i 30 minut na anulowanie transakcji.
- Obsługa transakcji, rozliczeń oraz rozrachunku odbywa się za pomocą standardowych komunikatów.
- KDPW_CCP pośredniczy w raportowaniu transakcji REPO do RT KDPW (zgodnie z SFTR).

ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W KDPW_CCP – zabezpieczenie ryzyka w transakcji REPO

Główne ryzyka:

- Ryzyko zmiany ceny obligacji
Właściwy depozyt zabezpieczający oraz depozyt zmienny
- Ryzyko zmiany stopy repo
- Ryzyko płynności i koncentracji
Add-on na płynność i koncentrację
- Ryzyko braku regulacji płatności kuponu
Depozyt zmienny

komponenty wymagania depozytowego



ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W KDPW_CCP – fundusz zabezpieczający

FUNDUSZ
ZABEZPIECZAJĄCY
ASO GPW BONDSPOT

GPW CATALYST
GPW NewConnect

ASO BONDSPOT

TBSP

BONDSPOT REPO

Główne zasady:

- wpłata minimalna w zależności od rynku, na którym działa dany uczestnik (inna wpłata dla uczestnika działającego na ASO GPW, inna dla segmentu TBSP);
- wartość funduszu wyznaczana na bazie ekspozycji największego uczestnika lub sumy drugiej i trzeciej największych ekspozycji;
- ekspozycje uczestników wyznaczone są na poziomie LEI;
- wpłata uczestnika proporcjonalna do wielkości jego ekspozycji;

OBSŁUGA ZAWIESZEŃ

Główne zasady:

- Obsługa zgodnie z dyscypliną rozrachunku CSDR;
- Uruchomienie procedury BUY-IN po dniu S+7:
 - Dla pierwszej nogi tylko jeżeli repo dłuższe niż 30 dni;
 - Repo krótsze niż 30 dni rozliczane pieniężnie w dniu rozrachunku drugiej nogi;
 - Dla drugiej nogi procedura BUY-IN realizowana w sposób standardowy;
- Sposób realizacji procedury BUY-IN:
 - Aukcja za pośrednictwem systemu GUI;
 - Zlecenie zakupu poprzez agenta buy-in;
- Powodujący zawieszenie pokrywa wszystkie koszty związane z obsługą zawieszenia;
- Rekompensaty wypłacane uczestnikom poszkodowanym w wyniku zmiany pierwotnego terminu lub anulowania rozrachunku;

KOMUNIKACJA


Istotne komunikaty dotyczące transakcji repo:

- **z KDPW_CCP:**
 - sese.sts.002.02 – potwierdzenie przyjęcia transakcji do rozliczenia;
 - colr.mrg.001.04 – szczegóły płatności z tytułu depozytów zabezpieczających (nowa wersja komunikatu);
 - colr.mrs.001.04 - Informacja dotycząca statusu limitu transakcyjnego zabezpieczających (nowa wersja komunikatu);
- **z KDPW:**
 - sese.sts.001.05 – status instrukcji rozrachunkowej.

OPŁATY

Nowy punkt Tabeli Opłat - Opłata z tytułu rozliczenia transakcji repo

Okres zapadalności	Stawka opłaty
1-2D	0.0005%
3-4D	0.0006%
5-7D	0.0007%
(1W;2W]	0.0010%
(2W;1M]	0.0015%
(1M;3M]	0.0020%
(3M;6M]	0.0040%
(6M;12M]	0.0080%



	HARMONOGRAM
9 lipca 2021	Szczegółowe materiały dotyczące nowej usługi, w tym informacje dotyczące zmian w komunikatach systemu kdpw_stream
2 stycznia 2022	Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów
23-24 kwietnia 2022	wdrożenie usługi rozliczania transakcji repo zawartych na platformie Treasury BondSpot Poland, w tym aukcji dla repo. Uruchomienie usługi rozliczania transakcji warunkowych planowane jest od 25 kwietnia 2022 r.

Pytania i odpowiedzi



04

Wprowadzenie depozytów dodatkowych, tzw. depozytów add-on

Marcin Truchanowicz



CEL I ZAKRES ZMIANY

Dostosowanie modelu obliczeń depozytów zabezpieczających do wymagań rozporządzenia EMIR i najlepszych praktyk rynkowych poprzez wprowadzenie dodatkowych komponentów wymaganych depozytów zabezpieczających ryzyko obliczanych na poziomie kontra rozliczeniowego:

- depozytu na ryzyko korelacji (WWR)
- depozytu na ryzyko płynności i koncentracji (LCR)

Aktualny wymagany depozyt zabezpieczający w OZ:

Depozyt SPAN + MTM (transakcje kasowe)

Nowy wymagany depozyt zabezpieczający:

Depozyt SPAN + MTM (transakcje kasowe) + depozyt WWR + depozyt LCR



ZABEZPIECZANE RYZYKO

Depozyt WWR

- Zabezpiecza ryzyko związane z ekspozycjami uczestnika rozliczającego i jego klientów w instrumentach własnych, które charakteryzuje wysoki stopień korelacji z ryzykiem kredytowym tego uczestnika

Pozycje generujące ryzyko WWR:

- pozycje w akcjach i obligacjach własnych danego uczestnika rozliczającego lub spółek z jego grupy kapitałowej,
- pozycje w kontraktach futures na akcje własne danego uczestnika rozliczającego lub spółek z jego grupy kapitałowej,
- pozycje w opcjach na akcje własne danego uczestnika rozliczającego lub spółek z jego grupy kapitałowej.



ZABEZPIECZANE RYZYKO

Depozyt LCR

Zabezpiecza ryzyko związane z wielkością pozycji uczestnika w danym instrumencie i możliwością jej zamknięcia przez KDPW_CCP na rynku w warunkach:

- obserwowanej płynności danego instrumentu,
- obserwowanego spreadu cenowego BID-ASK.

Ważne! Spodziewany wzrost depozytu dotyczy przede wszystkim dużych pozycji uczestnika rozliczającego w mniej płynnych instrumentach, charakteryzujących się mniejszym wolumenem obrotu i większym spreadem cenowym BID-ASK lub silnie skoncentrowanych pozycji.



WSPARCIE UCZESTNIKÓW

Nowe funkcje komunikatów kdpw_stream (dostępne do testów)

- **corl.mrg.001.03** - depozyty zabezpieczające na poziomie rynku (rynek regulowany lub ASO), na poziomie uczestnika rozliczającego, konta indywidualnego (NKK) oraz konta rozliczeniowego w podziale na rynek kasowy i rynek terminowy oraz w podziale na poszczególne komponenty ryzyka (depozyt SPAN®, wyrównanie do rynku, depozyt WWR, depozyt LCR)
- **colr.mrs.001.03** - aktualne wykonanie limitu transakcyjnego uczestnika rozliczającego oraz wymaganie depozytowe w podziale na rynki (rynek regulowany lub ASO), na uczestnika rozliczającego oraz poszczególne konta. Wymaganie depozytowe na poszczególne konta będzie prezentować wszystkie komponenty wymagania depozytowego z uwzględnieniem depozytu WWR i LCR
- **colr.mrl.001.03** - jednorazowe odpytanie o wymagania depozytowe dla wszystkich kont uczestnika rozliczeniowego bez konieczności ich specyfikacji
- **colr.adn.001.01** - komunikat z parametrami modelu obliczeń depozytów add-on,
- Możliwość uzyskania przez UR poglądowych wyników obliczeń depozytów add-on w systemie produkcyjnym.



WSPARCIE UCZESTNIKÓW

Nowe funkcje komunikatów kdpw_stream (planowane)

- W związku ze zmianami dotyczącymi uruchomienia rozliczeń repo komunikaty
- corl.mrg.001.03 - colr.mrs.001.03 – zostaną zastąpione swoimi nowymi wersjami – odpowiednio komunikatami: colr.mrg.001.04 oraz colr.mrs.001.04
- Nowe wersje komunikatów zostaną udostępnione do testów w II połowie listopada br.
- Komunikaty w nowej wersji oprócz występujących obecnie pól InitlMrgn, MtM, LCMrgn, WWRMrgn będą uwzględniały dodatkowe (opcjonalne) komponenty wymaganego depozytu zabezpieczającego, mające zastosowanie tylko dla transakcji repo:
 - 1) WR (MtM) - wyrównanie do rynku dla transakcji repo, które może przyjmować wartości ujemne
 - 2) DZR (RpRtMrgn) - depozyt zabezpieczający stopę repo.
- Uczestnicy, którzy nie będą rozliczać transakcji repo nie będą otrzymywać powyższych informacji.

↓	HARMONOGRAM
9 września 2020 30 listopada 2020 26 lutego 2021 20 maja 2021 20 lipca 2021	Przekazanie szczegółowych materiałów dot. planowanych zmian w modelu obliczeń depozytów zabezpieczających w związku z wprowadzeniem depozytów add-on (pisma: CCP/ZW/582/2020 z dnia 9 września 2020 r., CCP/ZW/768/2020 z dnia 30 listopada 2020 r., CCP/ZW/161/2021 z dnia 26 lutego 2021 r., CCP/ZW/355/2021 z dnia 20 maja 2021 r. oraz CCP/ZW/498/2021 z dnia 20 lipca 2021 r.), w tym przekazanie struktur nowych komunikatów.
2 listopada 2020	Udostępnienie środowiska testowego
20 maja 2021 listopad 2021	<ul style="list-style-type: none"> - Udostępnienie w środowisku testowym możliwości odbioru komunikatu colr.adn.001.01 - Udostępnienie w środowisku testowym komunikatów w zakresie repo
15 lipca 2021	Udostępnienie w środowisku testowym oprogramowania zawierającego nowe struktury komunikatów: colr.adn.001.01, colr.mrg.001.03 i colr.mrs.001.03.
I kwartał 2022	Zmiana Rozporządzenia w sprawie trybu i warunków postępowania firm inwestycyjnych, banków, o których mowa w art. 70 ust. 2 ustawy
23-24 kwietnia 2022*	<p>Wdrożenie depozytów add-on zabezpieczających ryzyko płynności i koncentracji oraz ryzyko korelacji</p> <p><small>*Warunkiem wdrożenia nowego modelu obliczeń depozytów zabezpieczających jest uzyskanie przez KDPW_CCP zgody KNF i ESMA na przeprowadzenie istotnej zmiany w modelu zarządzania ryzykiem (oczekiwane w IV kw. 2021)</small></p>

Pytania i odpowiedzi



05

Włączenie rozliczeń i zarządzania ryzykiem dla transakcji OTC do systemu kdpw_stream

Żaneta Skorupska-Świrska



KORZYŚCI Z WDROŻENIA ROZLICZEŃ OTC W SYSTEMIE KDPW_STREAM:

- dostosowanie komunikatów do zmian postulowanych przez Uczestników OTC;
- udostępnienie aukcji OTC poprzez GUI KDPW_CCP;
- rozszerzenie wykorzystania komunikatów w formacie FpML (obsługiwane m.in. przez Markit i LCH);
- większa elastyczność i niższe koszty wprowadzania zmian do systemu;

WYZWANIA:

- Wdrożenie usługi Client Clearingu przez kolejnych uczestników rozliczających w KDPW_CCP (Client Clearing stanowił poniżej 0,1% wartości rozliczeń w 2021 r.);
- Zwiększenie wykorzystania usługi Client Clearingu w transakcjach dokonywanych pomiędzy bankami oraz:
 - polskimi instytucjami finansowymi (TFI, ubezpieczyciele),
 - polskimi uczestnikami niefinansowymi,
 - zagranicznymi uczestnikami rynku derywatów OTC.
- Zwiększenie udziału w rynku derywatów OTC w PLN polskich banków poprzez:
 - zawieranie transakcji z polskimi małymi bankami,
 - niefinansowymi instytucjami zagranicznymi obsługiwanymi przez polskie banki posiadające usługę Client Clearing.

ZMIANY W KOMUNIKACJI Z UR KDPW_CCP:

komunikaty FpML:

- **komunikaty FpML** - przekazywanie statusów transakcji OTC przyjętych do rozliczenia, w tym informacji o potwierdzeniu przyjęcia lub odrzuceniu, przekazanie szczegółów transakcji;
- wykorzystanie standardu FpML w wersji 5.11 opublikowany w grudniu 2019 r.;

komunikat colr.mrg.003.03:

- komunikat prezentujący płatności z tytułu depozytów zabezpieczających i pozostałych komponentów rozliczeń OTC (colr.mrg.003.03), uzupełnienie o informacje przekazywane w komunikacie E1, którego obsługa zostanie zaniechana wraz z wdrożeniem nowej struktury colr.mrg.003.03;

ZMIANY W KOMUNIKACJI Z UR KDPW_CCP c.d.:

zastąpienie komunikatów z grupy Z:

Zmiany związane z obsługą „raportów na żądanie” – zastąpienie komunikatów z „grupy Z” komunikatami:


- otcc.cfl.001.01 Raport Cash flows,
- otcc.cpn.001.01 Raport Coupons fixing,
- otcc.npv.001.01 Raport NPV per Leg,
- otcc.pmt.001.01 Raport Payments,
- otcc.tra.001.01 Raport All Trades,
- otcc.trn.001.01 Raport New Trades,
- otcc.trs.001.01 Raport Settled Trades,
- otcc.vtn.001.01 Raport Daily Variation,
- otcc.rqs.001.01 Żądanie przekazania raportu;

ZMIANY W KOMUNIKACJI Z UR KDPW_CCP c.d.:

zmiany komunikatów związane z obsługą aukcji:

Zmiany związane z obsługą aukcji - komunikaty FpML (FpML valuationReport: AuctionTradesOffered i AuctionTradesAcquired) oraz nowe komunikaty:

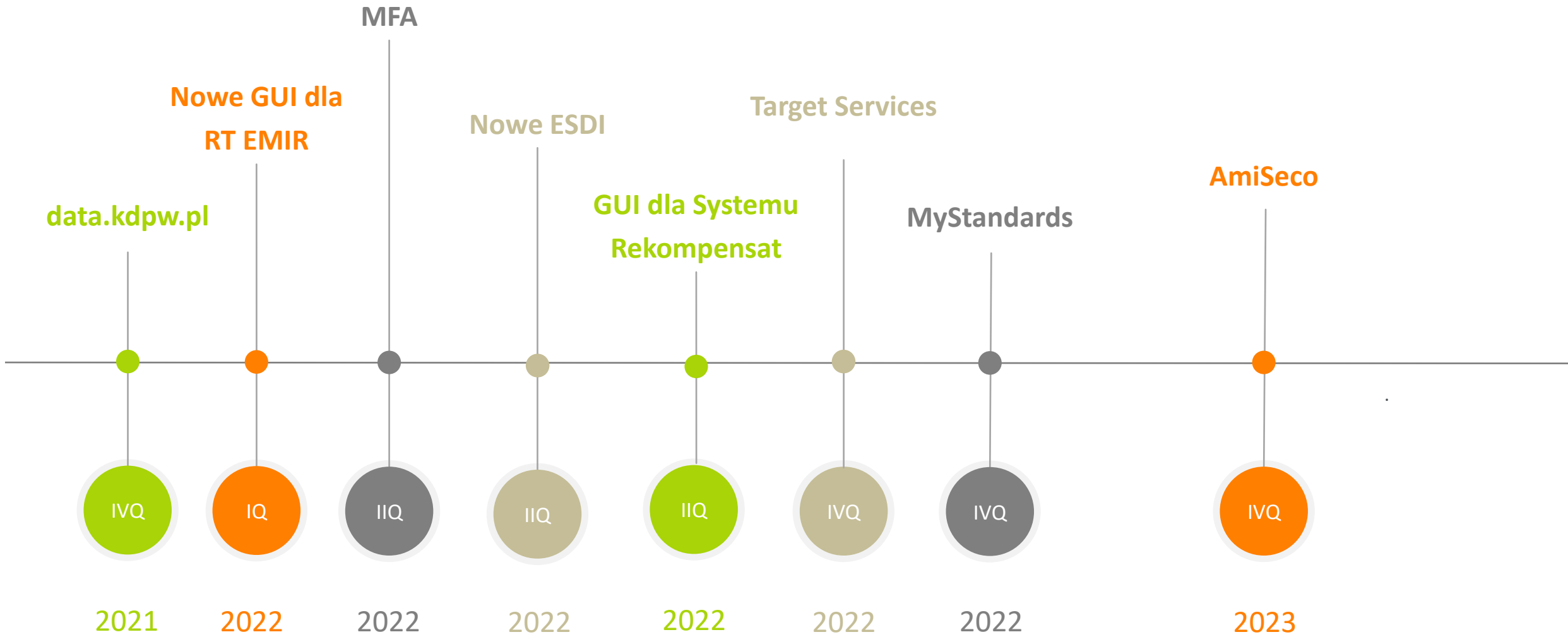
- auct.ntf.001.01 Obsługa aukcji - ogłoszenie warunków aukcji,
- auct.qtn.001.01 Obsługa aukcji - przekazanie kwotowania,
- auct.rqs.001.01 Obsługa aukcji - inicjacja aukcji na żądanie,
- auct.stq.001.01 Obsługa aukcji - status kwotowania,
- auct.str.001.01 Obsługa aukcji - status żądania rozpoczęcia aukcji,
- auct.oda.001.01 Obsługa aukcji - akceptacja wyniku aukcji na żądanie,
- auct.odr.001.01 Obsługa aukcji - wynik aukcji na żądanie.



	HARMONOGRAM
9 lipca 2021	Przekazanie szczegółowych informacji dotyczących zastosowania w systemie rozliczeń dla instrumentów pochodnych OTC komunikatów FpML oraz informacji o zmianach komunikatów systemowych (pismo CCP/ZW/487/2021 z dnia 9 lipca 2021 r.)
1 kwietnia 2022	Udostępnienie środowiska testowego oraz rozpoczęcie testów
1 lipca 2022	Rozpoczęcie testów w zakresie aukcji OTC
22-23 października 2022	Wdrożenie zmodernizowanego systemu rozliczeń dla transakcji OTC

Pytania i odpowiedzi





06

Uruchomienie nowych funkcji Portalu danych Grupy KDPW

Sławomir Zając



DLACZEGO ZMIANA?

- Zastąpienie obecnego serwisu prezentującego dane statystyczne produktem o wyższej jakości i nowych funkcjonalnościach,
- Postęp technologiczny. Obecny SPDS funkcjonuje od 2009 r. na technologicznie przestarzałej i trudnej w utrzymaniu infrastrukturze (bez wsparcia producenta infrastruktury),
- Zwiększenie dostępności, niezawodności technicznej i jakości danych
- Wykorzystanie przez KDPW potencjału wynikającego z posiadania danych na wzór innych centralnych depozytów papierów wartościowych,
- Uregulowanie sposobu i zakresu wykorzystywania danych referencyjnych i statystycznych przez użytkowników zewnętrznych:
 - Regulamin usługi sprzedaży danych,
 - Zasady korzystania z danych bezpłatnych.

Ważne! zamknięcia dotychczasowego serwisu Statystyki kdpw_stream nastąpi 10 stycznia 2022 r.



KORZYŚCI DLA RYNKU

- Dostęp do danych udostępnianych za pośrednictwem nowoczesnych i wystandaryzowanych mechanizmów,
- Dwa kanały dystrybucji danych:
 - formularze manualne z możliwością eksportu do formatu JSON, XLS i XML,
 - API - opracowana zgodnie ze standardem OpenAPI w wersji 3.0.3.
- Dostęp do bieżących danych referencyjnych,
- Elastyczność w zakresie zarządzania dostępem do danych w Państwa organizacji w sposób zdalny za pośrednictwem Portalu danych,
- Stałe merytoryczne wsparcie dla klientów serwisu płatnego,
- Ujednolicenie zasad pobierania i dystrybucji danych.



PORTAL DANYCH – TRYBY UDOSTĘPNIANIA DANYCH

Dane z portalu danych data.kdpw.pl udostępniane będą na trzech poziomach:


odpłatnie - dla zalogowanych użytkowników

nieodpłatnie - dla zalogowanych użytkowników

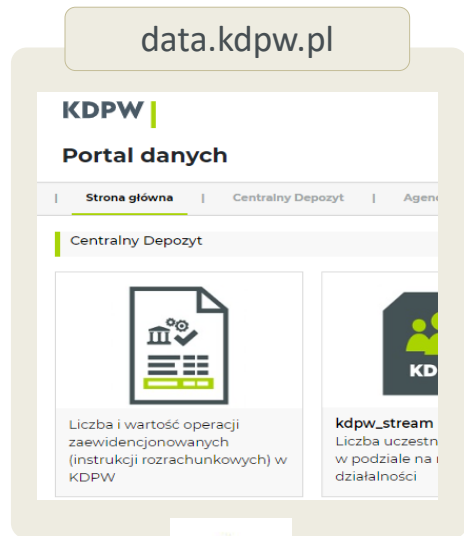
- dane referencyjne i informacje statystyczne z działalności CSD KDPW oraz KDPW_CCP zawarte w ramach pakietu bezpłatnego,
- aplikacja RGI,
- raport o liczbie rachunków prowadzonych przez podmioty uprawnione do prowadzenia rachunków papierów wartościowych,

nieodpłatnie - bez konieczności logowania (w kanale otwartym)

- RZE.INFO,
- zagregowane statystyki tygodniowe RT EMIR ,
- zagregowane statystyki tygodniowe RT SFTR.



	HARMONOGRAM
1 marca 2021	Uruchomienie Portalu danych Grupy KDPW (https://data.kdpw.pl) – dane bezpłatne
1 września 2021	Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów (funkcjonalności serwisu płatnego)
08 listopada 2021	Udostępnienie cennika serwisu płatnego
22 listopada 2021	Udostępnienie raportów obejmujących pełen zakres informacyjny serwisu płatnego z opcją ręcznego pobrania danych w pliku (do 31 grudnia 2021 r. – nieodpłatnie w serwisie bezpłatnym)
31 grudnia 2021	Wdrożenie funkcjonalności umożliwiających zakup danych, z opcją pobrania danych w pliku (poprzedzone publikacją Regulaminu usługi)
do 31 grudnia 2021	Przekazanie szczegółowych warunków świadczenia usługi sprzedaży danych za pomocą interfejsu API.
31 marca 2022	Wdrożenie funkcjonalności umożliwiających dostęp do danych płatnych za pomocą interfejsu API.



Ważne! Pełen zakres informacyjny raportów dostępny jest na stronie Portalu danych:

<https://data.kdpw.pl/p/structures>

Zakres informacyjny serwisu płatnego:

- Raport 1. Dot. instrumentów finansowych zarejestrowanych w KDPW_CCP,
- Raport 2. Dot. instrumentów finansowych zarejestrowanych lub zakodowanych w KDPW,
- Raport 3. Dot. kontrahentów i ich danych tj.: LEI, NIP, REGON podmiotu,
- Raport 4. Dot. instrumentów finansowych przyjętych/wykluczonych z KDPW,
- Raport 5. Dot. kapitalizacji instrumentów finansowych rejestrowanych na kontach uczestników KDPW (z podziałem na rodzaj uczestnika),
- Raport 6. Dot. uczestników i emitentów KDPW,
- Raport 7. Dot. zdarzeń korporacyjnych/przejęć instrumentów finansowych zarejestrowanych w KDPW.



Zakres informacyjny Raportu 1 Instrumenty finansowe rejestrowane w KDPW_CCP:

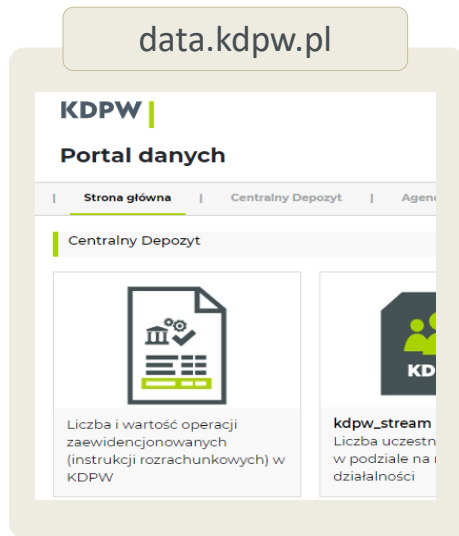
- Lista kodów ISIN instrumentów pochodnych zarejestrowanych w KDPW_CCP wraz z identyfikatorami CFI i FISN.
- Charakterystyka instrumentów pochodnych.
- Liczba otwartych pozycji.
- Wartość rynkowa instrumentów.
- Informacje o rynku notowań.
- Liczba i wartość rozliczonych transakcji.

Ważne! Od 31 marca 2022r. planowane jest rozszerzenie raportu o instrumenty rynku kasowego.



Zakres informacyjny Raportu 2 Instrumenty finansowe zarejestrowane lub zakodowane w KDPW:

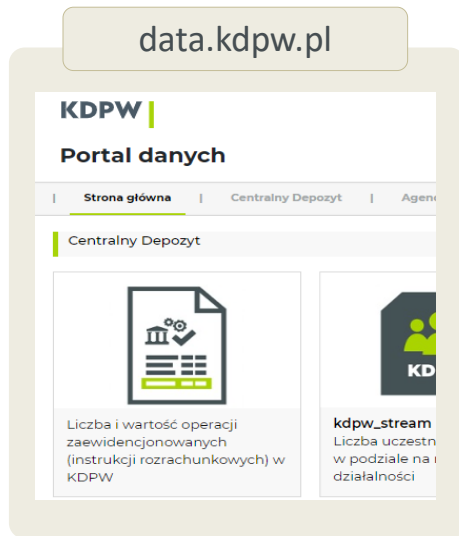
- Lista kodów ISIN zarejestrowanych w KDPW wraz z identyfikatorami CFI i FISN.
- Charakterystyka instrumentów finansowych (data wygasania, rok emisji, kategoria instrumentu).
- Wielkość emisji i wartość nominalna instrumentów.
- Identyfikacja emitenta (kod instytucji, LEI).
- Wartość rynkowa instrumentów.
- Wycena instrumentów finansowych.
- Informacje o rynku notowań.
- Liczba i wartość rozrachowanych transakcji w podziale na kod ISIN.



Zakres informacyjny Raportu 3 Kontrahenci GK KDPW i ich dane tj.: LEI, NIP, REGON:

- Kod LEI.
- Status rejestracji kodu LEI.
- Nazwa pełna podmiotu.
- NIP.
- REGON.
- Forma prawna.
- Typ rejestru biznesowego.
- Id podmiotu w rejestrze biznesowym.

Ważne! Z chwilą uruchomienia serwisu płatnego raport nie będzie zawierał danych osób fizycznych prowadzących działalność gospodarczą. Raport będzie uzupełniany sukcesywnie w miarę uzyskiwania zgód od tych podmiotów.



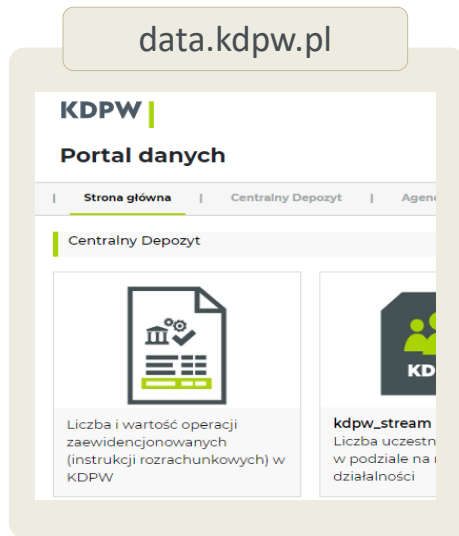
Zakres informacyjny Raportu 4 Instrumenty finansowe przyjęte / wykluczone z KDPW:

- Kod ISIN.
- Typ zdarzenia:
 - Rejestracja,
 - Wyrejestrowanie.
- Data zdarzenia.
- Liczba instrumentów finansowych.
- Oznaczenie emisji – seria.
- Cena emisyjna.



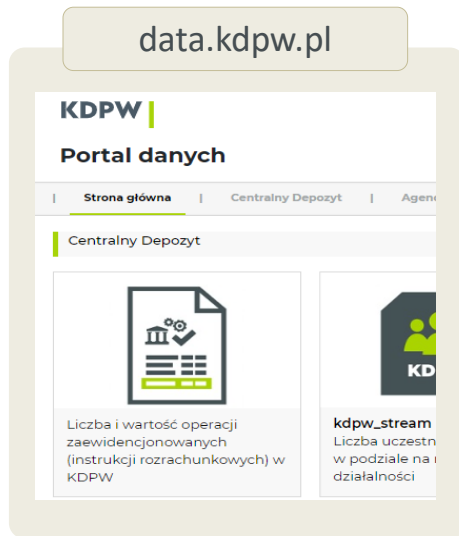
Zakres informacyjny Raportu 5 Kapitalizacja instrumentów finansowych rejestrowanych na kontach uczestników KDPW (z podziałem na rodzaj uczestnika):

- Data.
- Rodzaj uczestnictwa.
- Kategoria instrumentu.
- Kapitalizacja.



Zakres informacyjny Raportu 6 Uczestnicy i Emitenci CSD KDPW:

- Kod instytucji.
- Kod LEI.
- Nazwa pełna uczestnika/emitenta.
- Typ uczestnictwa.
- Data przyjęcia do KDPW.



Zakres informacyjny Raportu 7 Zdarzenia korporacyjne / przejęcia Instrumentów finansowych:

- Rodzaj zdarzenia korporacyjnego.
- ISIN papieru głównego.
- ISIN papieru przejmowanego.
- Kategoria instrumentu głównego / przejmowanego.
- Kod instytucji emitenta.
- Pełna nazwa emitenta.
- Data ustalenia praw.
- Data zdarzenia / wykupu.
- Wartość zdarzenia / warunki zdarzenia (np. przejęcie 1:5).



OPŁATY

- Klienci zamawiać będą subskrypcje płatne, w których określać będą zakres dostępu oraz wybierać pakiety danych.
- Pakiet danych to zestawienie jednego lub większej liczby raportów.
- KDPW ustala liczbę udostępnianych pakietów oraz przypisanie raportów do pakietów.
- Z chwilą uruchomienia usługi planujemy następujące przyporządkowanie raportów do pakietów:

Pakiet	Raporty
Pakiet I. Instrumenty CCP:	Raport 1.
Pakiet II. Instrumenty CSD:	Raport 2.
Pakiet III. Podmioty i instytucje:	Raport 3, Raport 6.
Pakiet IV. Dane CSD:	Raport 4, Raport 5, Raport 7.

Ważne! Od 31 marca 2022r. planowane jest dodanie 8 raportu o z globalną bazą kodów LEI. Raport ten uzupełni pakiet 3.



OPŁATY c.d.

Opłaty za pakiet

Opłaty	Miesięczne	Roczne
za 1 pakiet	400 PLN	2 400 PLN
Stały system rabatowy w przypadku zakupu <ul style="list-style-type: none"> • dwóch pakietów: zniżka 10% za każdy pakiet, • trzech pakietów: zniżka 20% za każdy pakiet, • czterech lub więcej pakietów: zniżka 30% za każdy pakiet. 		

Opłaty za dostęp

Opłaty	Miesięczne	Roczne
do 3 użytkowników	100 PLN	600 PLN
do 6 użytkowników	300 PLN	1800 PLN
do 50 uczestników	600 PLN	3 600 PLN
API*	N/A	12 000 PLN

Ważne! * API zostanie uruchomione 31.03.2022r.



API DLA PODMIOTÓW ZAINTERESOWANYCH AUTOMATYZACJĄ PROCESÓW

- Szczegółowa dokumentacja API zostanie opublikowana w Portalu danych do 31.12.2021 r.,
- API produkcyjnie zostanie udostępnione 31.03.2022 r.,
- W środowisku testowym udostępniliśmy blisko dwadzieścia widoków API pozwalających pobrać dane z 7 przygotowanych dla Państwa raportów,
- Dostęp do API będzie można dokupić w trakcie zamawiania subskrypcji lub w trakcie jej trwania,
- Wykupienie dostępu API będzie oznaczało możliwość pobierania wszystkich danych zamówionych w ramach subskrypcji,
- Szczegóły techniczne dotyczące API znajdą Państwo pod poniższym linkiem: <https://tst-data.kdpw.pl/developers/>

Ważne! zamknięcia dotychczasowego serwisu Statystyki kdpw_stream nastąpi 10 stycznia 2022 r.

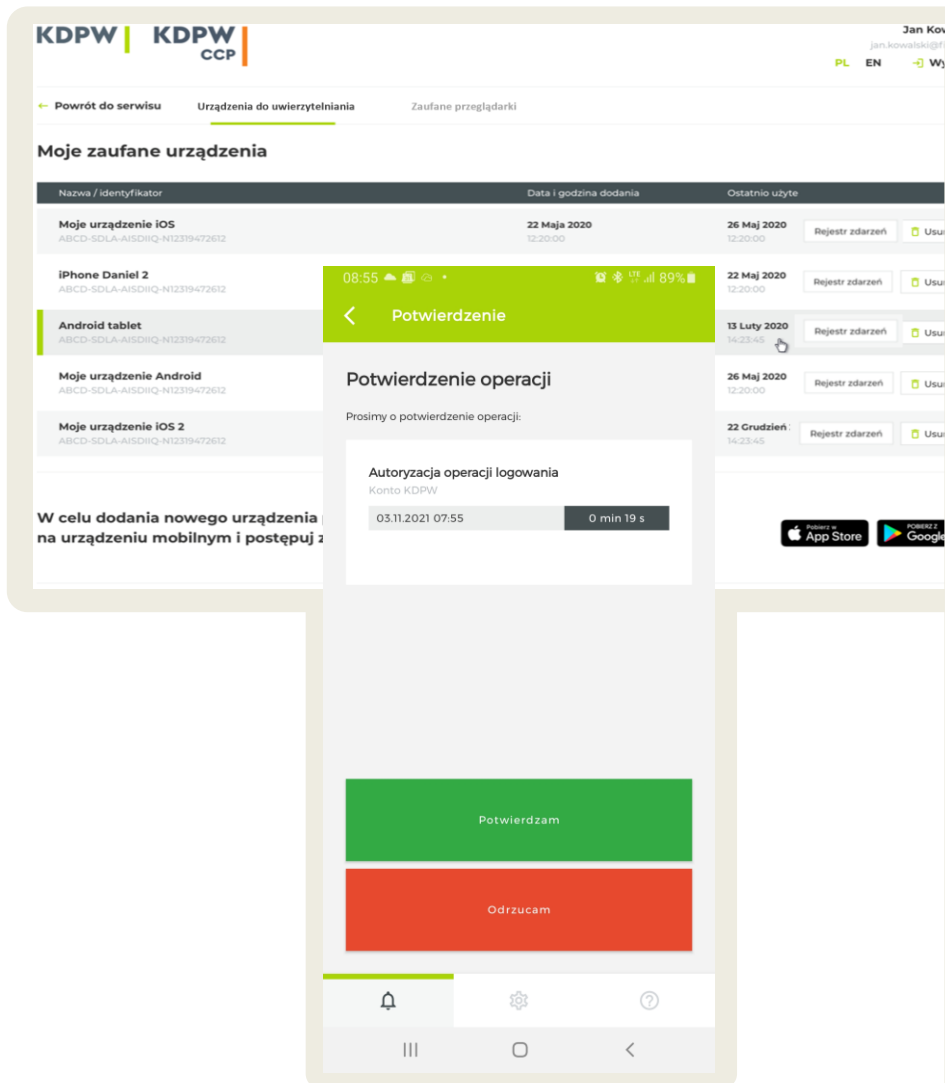
Pytania i odpowiedzi




07

Uruchomienie systemu uwierzytelniania dwuskładnikowego (MFA)

Ludwik Rytter



- wzrost zagrożeń dotyczących bezpieczeństwa systemów informatycznych dostępnych w modelu online,
- zwiększanie ilości usług jakie GK KDPW oferuje Państwu za pośrednictwem sieci Internet,
- uznając, jako priorytet Państwa bezpieczeństwa oraz biorąc pod uwagę wyniki analizy ryzyka dokonanej zgodnie z Wytycznymi Komisji Nadzoru Finansowego dotyczące zarządzania obszarami technologii informacyjnej i bezpieczeństwa środowiska teleinformatycznego w podmiotach infrastruktury rynku, pragniemy poinformować, że planujemy z dniem 1 kwietnia 2022 r. KDPW wprowadzić dodatkowy mechanizm uwierzytelniania zabezpieczający dostęp do aplikacji GK KDPW.
- dodatkowym mechanizmem podczas logowania do wybranych zasobów online GK KDPW poza dotychczasową parą atrybutów login, hasło wymagać będzie potwierdzenie operacji logowania z wykorzystaniem mobilnej aplikacji KDPW Group Authenticator,
- aplikację KDPW Group Authenticator będzie można pobrać za darmo z autoryzowanych sklepów – Google Play dla systemów Android oraz App Store dla systemów iOS,
- wymagane będzie przeprowadzenie parowania pobranej aplikacji z każdym posiadanym kontem (online.kdpw.pl),
- planujemy wdrożenie możliwości dodawania zaufanych przeglądarek co ułatwi proces logowania dla osób regularnie korzystających z usług GK KDPW.



	HARMONOGRAM
od grudnia 2021 do marca 2022	Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów
1 kwietnia 2022	Wdrożenie dodatkowego mechanizmu uwierzytelniania przy użyciu aplikacji mobilnej KDPW Group Authenticator. Od dnia wdrożenia tego mechanizmu, tożsamość użytkownika korzystającego z wybranych elektronicznych usług GK KDPW weryfikowana będzie z wykorzystaniem dwóch składników bezpieczeństwa.

Pytania i odpowiedzi



08

Portal online.kdpw.pl – uruchomienie nowych aplikacji

Ludwik Rytter

Nowe GUI dla
RT EMIR

Nowe ESDI

GUI dla Systemu
Rekompensat

IQ

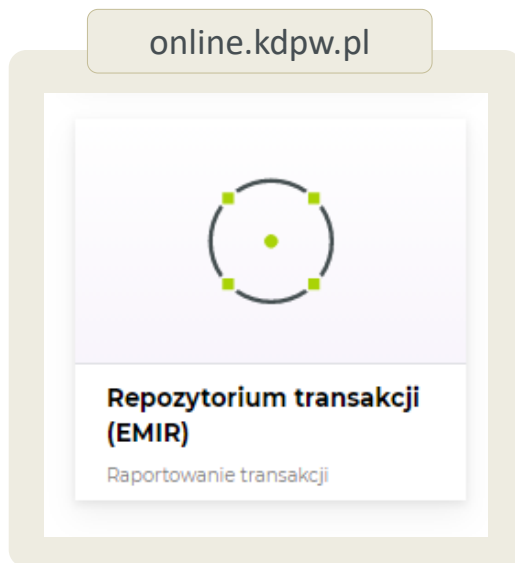
IIQ

IIQ

2 stycznia 2022

1 lipca 2022

1 lipca 2022



KDPW | TR Środowisko integracyjne (LAB) PL | EN Wyloguj

Mój pulpit **Repozytorium transakcji (EMIR)** Uprawnienia

← Hide **Relations** Refresh Export relations

UTC: Wed, 03 Nov 2021 13:15:45

Bank of Sulejówek
LEI code: 259400ZWGUR000000011
Type of participation: GUR
Subtype: GUR CAP M
Communication code: RZ41

Select participant

XML file import
Reporting service >
Active derivatives
Non-active derivatives
Deleted derivatives
Communication
Exported data
Invoice analytics
Relations

Relations


Filters

RC	Status
259400ZWZUR000000017	ISSUED
259400NQOUU0HS29YD02	ISSUED
259400J29BSMFJW9RP24	ISSUED
2594000K576D5CQXI987	ISSUED

10 4 items

Główne korzyści z wdrożenia nowego GUI dla Repozytorium transakcji (EMIR):

- zmodernizowany system dostępu pozwoli na wzrost efektywności korzystania z aplikacji w zakresie dostępu do zaraportowanych danych,
- interfejs zostanie dostosowany pod względem wizualnym i nawigacyjnym do innych aplikacji udostępnianych przez GK KDPW (m.in. ARM, SFTR),
- pojawią się nowe lub zmienione funkcjonalności, takie jak:
 - przyjazna i bardziej intuicyjna nawigacja,
 - filtry dostosowane do potrzeb Użytkowników;
 - zakładka Relations umożliwiająca m.in. zgłoszenie kodów LEI podmiotów delegujących raportowanie oraz podgląd statusów zgłoszonych kodów LEI.



	HARMONOGRAM
22 listopada 2021	Udostępnienie środowiska testowego TSTB oraz rozpoczęcie testów
22 listopada – 16 grudnia 2021	Testy z uczestnikami RT EMIR
2 stycznia 2022	Wdrożenie na online.kdpw.pl nowej wersji aplikacji, w tym w szczególności nowego GUI (interfejsu dla klientów) na środowisko produkcyjne (PRD) i edukacyjne (EDU)




Uczestnicy systemu rekompensat uzyskają dostęp do nowej aplikacji działającej w ramach portalu usług online.kdpw.pl, stanowiącej przyjazne narzędzie do wymiany danych z KDPW w zakresie systemu rekompensat. Rozwiązanie, obok SWI, będzie alternatywnym sposobem przekazywania przez uczestników wymaganych danych do systemu rekompensat.

GUI dla Systemu Rekompensat umożliwi:

- Przekazywanie przez uczestników danych do systemu rekompensat, m. in. o średniej wartości aktywów, liczbie inwestorów,
- Przegląd i pobieranie informacji o operacjach zwiększających i zmniejszających udział uczestnika w systemie rekompensat, m. in. ustalonej nadwyżce wpłaty, wypracowanym przychodzie, potrąconych kosztach i opłatach, wypłatach rekompensat,
- Odczytywanie powiadomień o zbliżających się terminach spełnienia obowiązków wynikających z uczestnictwa w systemie rekompensat,

Główne korzyści z wdrożenia GUI dla Systemu Rekompensat:

- skrócenie procesu przepływu danych,
- uproszczenie sposobu przygotowywania i przekazywania informacji.



	HARMONOGRAM
31 maja 2022	Przekazanie uczestnikom Systemu Rekompensat instrukcji użytkownika Udostępnienie środowiska testowego oraz rozpoczęcie testów
1 lipca 2022	Wdrożenie na online.kdpw.pl GUI dla uczestników Systemu Rekompensat

online.kdpw.pl



Centralny Depozyt




Izba Rozliczeniowa



W ramach modernizacji systemu ESDI/WEB służącego do wymiany komunikatów systemowych oraz korespondencji, obszar funkcjonalny realizowany w ramach obecnego ESDI/WEB zastąpią odrębne aplikacje:

- agregujące wszelkie funkcje związane z dystrybucją korespondencji pomiędzy KDPW a Uczestnikami KDPW oraz odrębnie pomiędzy KDPW_CCP a uczestnikami KDPW_CCP,
- umożliwiające przekazywanie komunikatów systemowych XML w modelu U2A, odrębnie dla KDPW i KDPW_CCP w zakresie dostępu do właściwych części kdpw_stream.



	HARMONOGRAM
luty 2022	Przekazanie szczegółowych informacji dotyczących zmian w systemie ESDI
marzec 2022	Udostępnienie środowiska testowego oraz rozpoczęcie testów
1 lipca 2022	Wdrożenie na online.kdpw.pl nowych aplikacji, zastępujących dotychczasowy system ESDI

Pytania i odpowiedzi

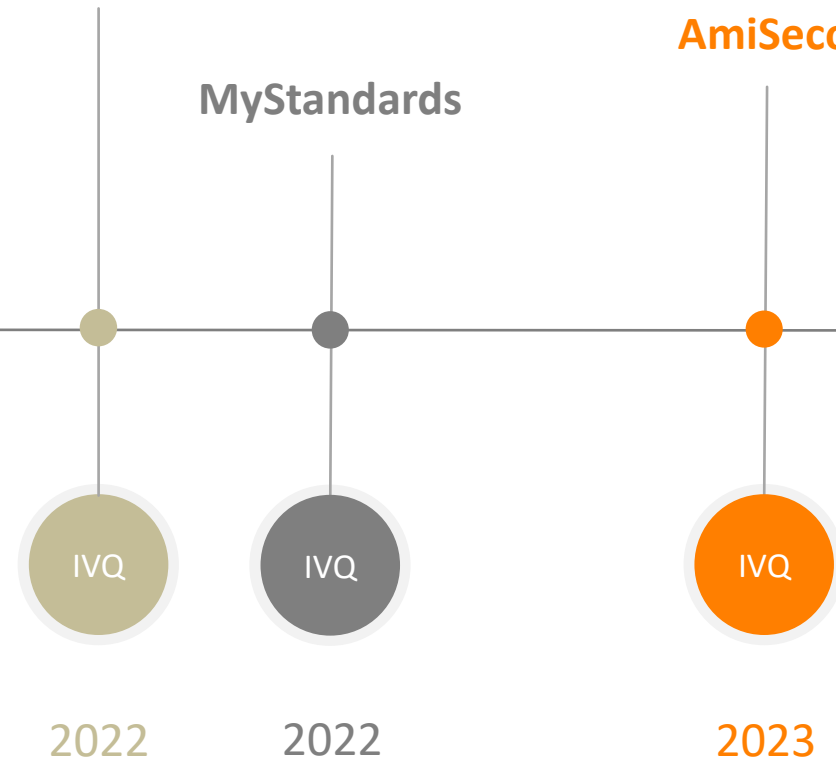


09

Target Services, MyStandards, AmiSeco

Leszek Kołakowski, Marcin Zawistowski

Target Services





Target Services


W listopadzie 2022 r. paneuropejski system międzybankowych rozliczeń w euro **Target2** prowadzony przez Eurosystem zostanie zastąpiony usługą **T2**, która stanie się jednym z elementów pakietu **Target Services**.

Target Services (łączna nazwa usług infrastruktury rynkowej Eurosystemu: T2 (RTGS i CLM), Target2 Securities (T2S) oraz Target Instant Payment Settlement (TIPS)).

Projekt znany jest również pod nazwą **Konsolidacja T2-T2S**.


Projekt prowadzony jest przez Eurosystem (EBC wraz z bankami centralnymi strefy euro), a na rynku polskim koordynowany przez **NBP**.

KDPW i KDPW_CCP uczestniczą w T2 jako tzw. systemy zewnętrzne (**ancillary systems**).



↓

	HARMONOGRAM
grudzień 2021 - wrzesień 2022	Testy uczestników T2 (user testing)
I - III kwartał 2022	Testy z uczestnikami KDPW i KDPW_CCP Poza zestawem obowiązkowych testów wymaganych przez EBC i NBP, KDPW i KDPW_CCP planują testy z udziałem uczestników, ze szczególnym uwzględnieniem płatników, w celu weryfikacji poprawności procesu rozrachunku w KDPW i KDPW_CCP dla waluty EUR
21 listopada 2022	Wdrożenie nowego systemu T2

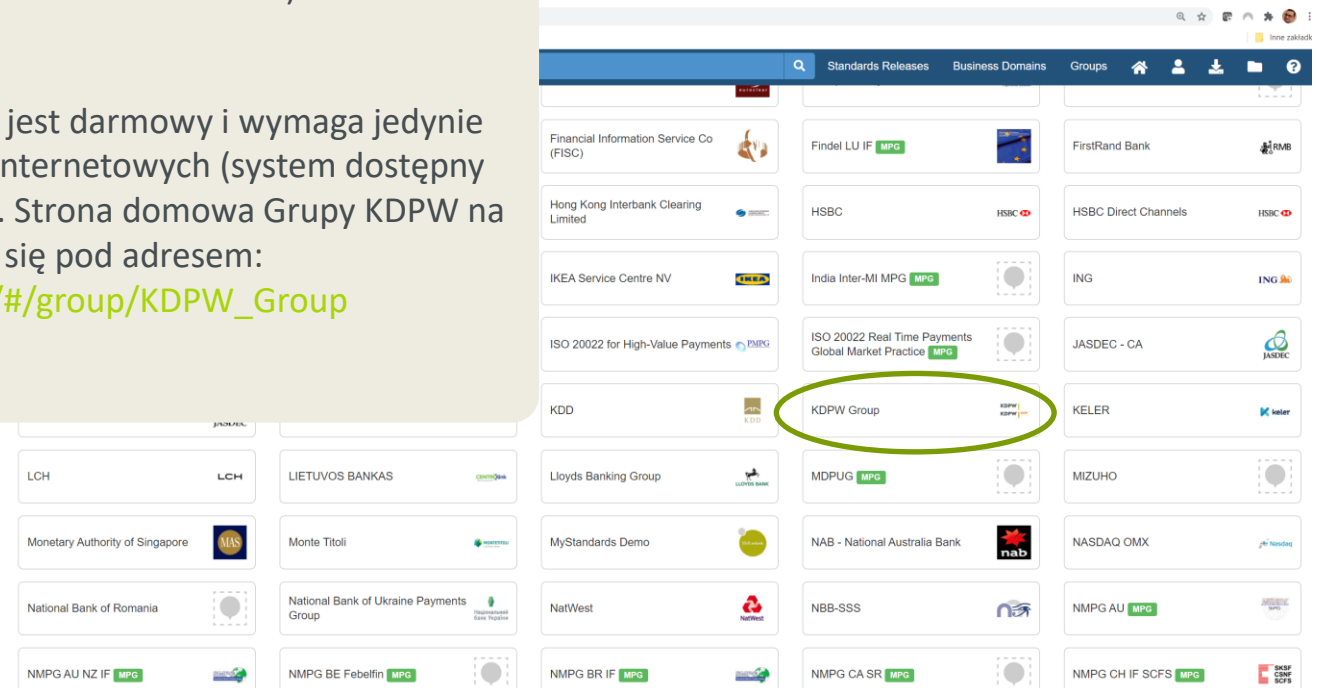






MyStandards

- Wykorzystywana do publikacji przez ponad **130** instytucji finansowych
- Ponad **53.000** zarejestrowanych użytkowników końcowych
- Wykorzystywana przez GK KDPW **od marca 2017** r. do dokumentacji komunikatów ISO15022 oraz ISO20022 (jako NMPG PL od **2014** r.)

Podstawowy dostęp do platformy MyStandards, jest darmowy i wymaga jedynie standardowej rejestracji, typowej dla serwisów internetowych (system dostępny jest pod adresem: <http://mystandards.swift.com>). Strona domowa Grupy KDPW na platformie MyStandards znajduje się pod adresem: https://www2.swift.com/mystandards/#/group/KDPW_Group





	HARMONOGRAM
1 stycznia 2023	Przeniesienie dokumentacji komunikatów systemowych dla wszystkich linii biznesowych GK KDPW na platformę <i>MyStandards</i>



W komunikacji z kontrahentami GK KDPW wykorzystuje:

- ~ **200** typów komunikatów własnych xml
- ~ **50** typów komunikatów ISO20022

Potrzeba wprowadzenia jednolitej i nowoczesnej metody zarządzania i publikacji specyfikacji komunikatów systemowych




AmiSeco

Wdrożenie opracowanych przez AMI-SeCo standardów dotyczących obsługi zdarzeń korporacyjnych oraz procesów fakturowania w ramach procesu harmonizacji zasad zarządzania zabezpieczeniami na rynku europejskim (Single Collateral Management Rulebook for Europe - SCoRE).

W ramach projektu planowana jest rozbudowa istniejącego oprogramowania w zakresie:

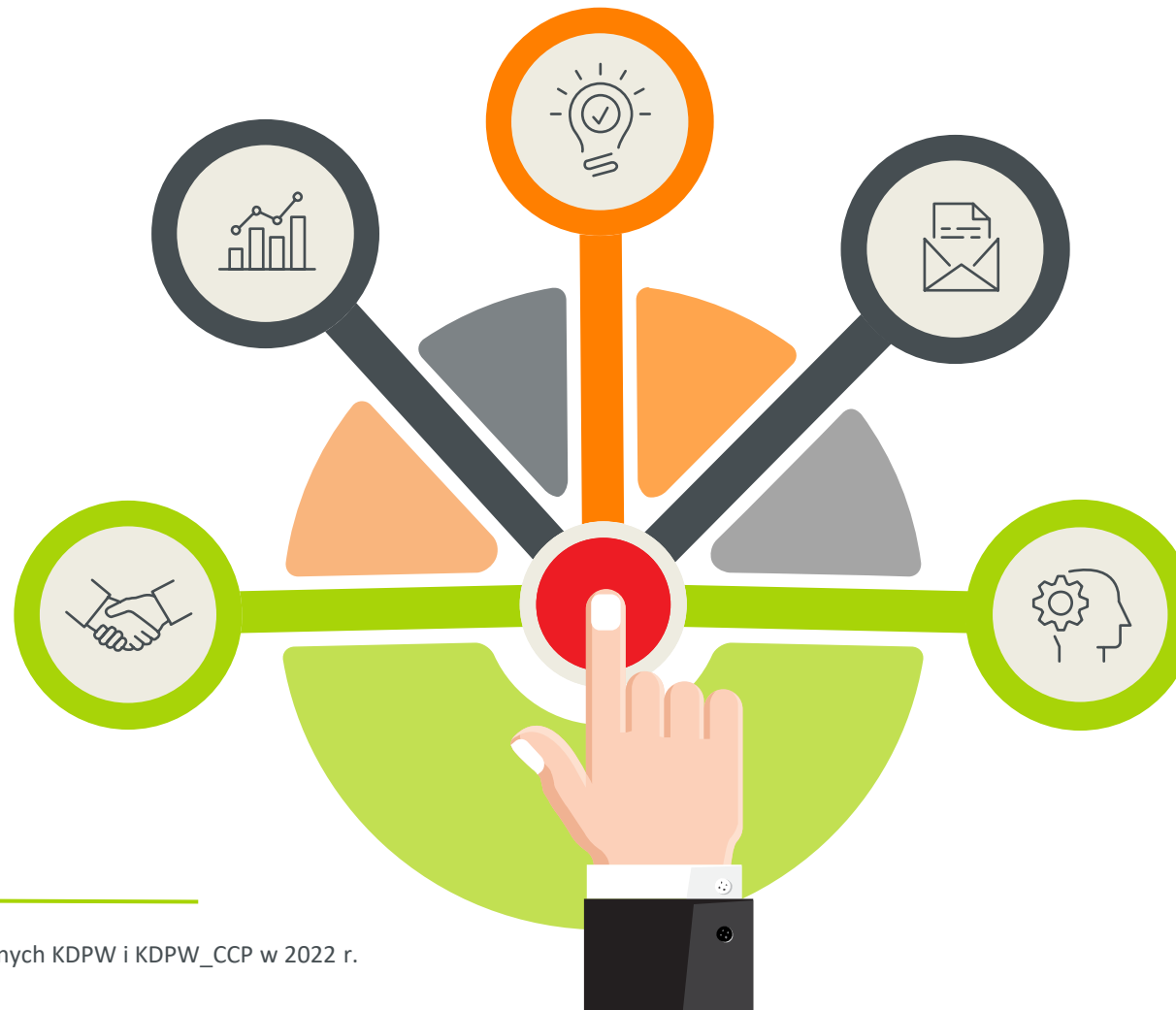
- komunikatów elektronicznych stosowanych do obsługi typowych zdarzeń korporacyjnych, których przedmiotem są instrumenty dłużne (a w przypadku rozszerzenia zakresu standardów, także instrumenty udziałowe i fundusze),
- komunikatów elektronicznych stosowanych do wymiany informacji związanych z fakturowaniem za usługi KDPW,
- interfejsu oferowanego przez KDPW na potrzeby obsługi zdarzeń korporacyjnych (m.in. aplikacja „Wypłata świadczeń”),
- standaryzacji procesów w zakresie obsługi zdarzeń korporacyjnych oraz fakturowania.



	HARMONOGRAM
8 kwietnia 2021	Przekazanie do AMI-SeCo planów adaptacyjnych dot. standardów Corporate Actions oraz Billing Processes, w ramach Single Collateral Management Rulebook for Europe (SCoRE).
30 lipca 2021	Pismo informujące o pracach projektowych mających na celu dostosowanie KDPW do standardów AMI-SeCo
marzec 2022	Przekazanie szczegółowych materiałów dotyczących projektowanych zmian w systemach informatycznych KDPW, związanych z dostosowaniem do standardów AMI-SeCo
od marca 2023	Udostępnienie środowiska testowego i rozpoczęcie testów (etapowo)
20 listopada 2023*	Wdrożenie standardów AMI-SeCo w zakresie zarządzania zabezpieczeniami (standardy Corporate Actions, Billing Processes)

*ostateczny termin wdrożenia może podlegać modyfikacji m.in. w przypadku spodziewanego rozszerzenia zakresu standardów na instrumenty udziałowe i fundusze

Pytania i odpowiedzi Podsumowanie





Dziękujemy za uwagę