

Centralne rozliczenie w KDPW_CCP transakcji zawartych na TBSP w obrocie zorganizowanym (start 5/10/2020)

Przyjęcie transakcji do rozliczenia

KDPW_CCP przyjmuje transakcje do rozliczenia wg harmonogramu obrotu na Rynku TBSP w godzinach 7:45 – 17:00.

Transakcje z segmentu kasowego dla TBSP będą oznaczone zgodnie ze standardem ISO (czteroznakowe oznaczenia) i zabezpieczone funduszem zabezpieczających ASO GPW BondSpot.

Uczestnik rozliczający dla sprzedającego i uczestnik rozliczający dla kupującego otrzymują z KDPW_CCP potwierdzenie przyjęcia transakcji do rozliczeń w komunikacie sese.sts.002.02 ze statusem <StsCd>PEND</StsCd> oraz

w sekcji: <SttIInstrDtIs>

<PlcOfTrad>EXCH/TBSP</PlcOfTrad>

<TradMode>CCPT</TradMode>.

W przypadku anulowania transakcji każdy uczestnik rozliczający otrzymują z KDPW_CCP potwierdzenie jej anulacji komunikatem sese.sts.002.02 ze statusem <StsCd>CAND</StsCd>.

Równoległe zgodnie z przekazaną przez uczestnika rozliczającego deklaracją wysyłane są komunikaty z grupy secl.00x.00x.0x.

Wzór dostępny jest w

zakładce: http://www.kdpwccp.pl/pl/Uczestnicy/Obrot_zorganizowany/Strony/Wzory-dokument%C3%B3w.aspx

Monitoring transakcji intrady

W trakcie sesji prowadzony jest monitoring stopnia wykorzystania limitu transakcyjnego określonego wg zabezpieczenia wniesionego przez Uczestników Rozliczających i wymaganych właściwych depozytów zabezpieczających w godzinach 7:45- 18:00. W trakcie trwania sesji na TBSP możliwe jest żądanie przez KDPW_CCP dopłaty zabezpieczenia w przypadku wykorzystania lub przekroczenia limitu transakcyjnego. W przypadku przekroczenia 100% wniesionego zabezpieczenia i braku uzupełnienia wstępnego depozytu rozliczeniowego w wyznaczonym terminie, możliwe będzie zablokowanie uczestnika zawierającego transakcje na TBSP.

Więcej informacji w zakresie monitoringu:

http://www.kdpwccp.pl/pl/Uslugi/Monitoring_sesji/Strony/default.aspx

Zabezpieczenia

W systemie gwarantowania rozliczeń prowadzonego przez KDPW_CCP zabezpieczenia podzielone są na:

- wstępny depozyt rozliczeniowych. Minimalna wpłata na wstępny depozyt rozliczeniowy wynosi 100.000 PLN (WDR łączny dla całego obrotu zorganizowanego).
- właściwy depozyt zabezpieczający. Brak wpłaty minimalnej, ponieważ wyliczany jest na podstawie aktualnej ekspozycji uczestnika rozliczającego według metodyki SPAN. Szczegóły dostępne są w serwisie internetowym pod linkiem (colr.mrg.001.02): <http://www.kdpwccp.pl/pl/zarzadzanie/Strony/metodologiaSPAN.aspx>.
- fundusz zabezpieczającego ASO GPW BondSpot. Minimalna wpłata do funduszu zabezpieczającego ASO GPW BondSpot wynosi również 100.000 PLN. Aktualizacja wpłat do FZ ASO wykonywana jest codziennie (komunikat colr.sgf.001.03, natomiast wpłaty lub zwroty realizowane są następnego dnia rano łącznie z pozostałymi zobowiązaniami/należnościami).

Wstępny depozyt rozliczeniowy może być uzupełniany w zakresie środków pieniężnych w walucie PLN w godzinach od 8:00 do 17:15, lub zwalniany od 8:00 do 17:15; wnoszenie środków pieniężnych w walucie EUR odbywa się w godz. od 8:00 do 12:00, zwalnianie od 8:00 do 14:00 oraz wnoszenie i zwalnianie papierów wartościowych od 8.00 do 18.15 zgodnie z harmonogramem dnia księgowego KDPW.

Wpłaty lub zwroty na wstępny depozyt rozliczeniowy Uczestnicy Rozliczający regulują poprzez wystawienie instrukcji do systemu KDPW_CCP.

Natomiast regulacja środków pieniężnych w walucie PLN z tytułu właściwych depozytów zabezpieczających oraz funduszu są inicjowane przez KDPW_CCP zgodnie z harmonogramem rozliczeń. Po każdorazowej zmianie w rejestrze zabezpieczeń prowadzonym przez KDPW_CCP Uczestnik Rozliczający otrzymuje komunikat o aktualnym stanie colr.sm1.002.03

Szczegóły dotyczące zabezpieczeń opisane są w zakładce:

http://www.kdpwccp.pl/pl/Uczestnicy/Zabezpieczenia/Documents/Zabezpieczenia_OZ.pdf

Rozliczenie transakcji

Początek sesji rozliczeniowej w KDPW_CCP następuje o godz. 18:00

W ramach sesji Uczestnicy Rozliczający otrzymują komunikaty postrozliczeniowe zawierające informacje o:

- płatnościach z tytułu właściwego depozytu zabezpieczającego dla rynku kasowego - colr.mrg.001.02;
- płatnościach w ramach funduszu zabezpieczającego - colr.sgf.001.03;
- zobowiązaniach lub należnościach w ramach systemu rozliczeń colr.stm.001.02;
- saldach rozliczeń pieniężnych camt.smt.001.04;
- przepływach papierów na dzień zawarcia transakcji semt.ssf.001.02;
- zawieszeniu rozrachunku w S+4 - komunikat secl.007.001.02

Szczegóły dotyczące komunikatów ich struktura i opis znajdują się w zakładce:

http://www.kdpwccp.pl/pl/Uczestnicy/Strony/Komunikaty_kdpw_stream.aspx

Za rozliczenie transakcji KDPW_CCP pobiera opłaty zgodnie z tabelą opłat będącą załącznikiem do Regulaminu rozliczeń transakcji OZ. Do punkt TO zostanie dodana odrębna opłata za rozliczenie transakcji sprzedaży na obligacjach z TBSP w wysokości 0,0035% wartości transakcji.

http://www.kdpwccp.pl/pl/Regulacje/obrotzorganizowany/Documents/2019/RRT_oz_01_10_2019_1.pdf

Regulacja płatności

Regulacja płatności wynikająca z wyliczonych zobowiązań i należności z tytułu właściwych depozytów zabezpieczających, funduszu zabezpieczającego odbywa się w dniu następnym podczas sesji płatniczej KDPW_CCP. Przelewy wynikające z kompensacji realizowane są poprzez rachunek w NBP wskazanego przez Uczestnika Rozliczającego – Banku Płatnika. Konta płatników w NBP są obciążane lub uznawane na podstawie dyspozycji KDPW_CCP. Przelewy realizowane są w godz. 8:00 – 8:30. Po aktualizacji stanów zabezpieczenia Uczestnicy Rozliczający otrzymują komunikaty statusowe colr.sm1.002.03.

Rozrachunek transakcji

Rozrachunek transakcji prowadzony jest w KDPW na podstawie zleceń rozrachunku przekazanych przez KDPW_CCP w dniu zawarcia transakcji (do rozrachunku w T+2).

W przypadku utrzymującego się zawieszenia rozrachunku w terminie S+4 KDPW_CCP przystępuje do procedury obsługi zawieszenia, składając ofertę nabycia brakujących papierów wartościowych na rynku BondSpot.

KDPW_CCP informuje Uczestnika o realizacji odkupu przy wykorzystaniu komunikatu secl.009.001.02 - potwierdzenie zawarcia transakcji odkupu papierów wartościowych.

Za zrealizowaną transakcją jest pobierana opłata w wysokości 1.000 PLN. Uczestnik powodujący zawieszenie otrzymuje refakturę VAT z tytułu opłat za transakcje zawarte przez KDPW_CCP na rynku.

Rozliczenie przychodów

Raz na kwartał Uczestnicy rozliczający otrzymują pocztą ESDI/WEB komunikat *.DGR zawierający dane dotyczące przychodów z inwestycji środków pieniężnych systemu zachowania płynności rozliczania transakcji. Dodatkowo po zakończeniu każdego miesiąca wysyłany jest komunikat colr.sm2.001.01 z informacją o prognozowanej wartości pożytków.

<http://www.kdpwccp.pl/pl/Uczestnicy/Pozytki/Strony/default.aspx>

Pozostałe informacje dotyczące przystąpienia do testów w systemie rozliczeń, struktury kont i konfiguracji uczestników rozliczających, przykładowych komunikatów proszę kierować na AT_TEST@kdpw.pl.