

CCP/ZW/729/2021

Warszawa, 16 listopada 2021 r.

Uczestnicy KDPW_CCP
(obróć zorganizowany)

Szanowni Państwo,

uprzejmie informujemy, że projekt uruchomienia w KDPW_CCP usługi rozliczeń transakcji warunkowych (repo) zawieranych na TBSP prowadzonym przez BondSpot w segmencie rynku ASO dla obrotu zorganizowanego od początku przyszłego tygodnia zgodnie z harmonogramem wchodzi w fazę testów. W związku z tym zmiany dotyczące rozliczeń i zabezpieczenia transakcji warunkowych repo zawieranych na TBSP **w dniu 22 listopada 2021 r. (poniedziałek)** zostaną udostępnione w naszym środowisku testowym TSTB.

W szczególności prosimy o zwrócenie uwagi na istotne zmiany w następujących komunikatach:

- ✓ komunikaty colr.mrg.001.04 i colr.mrs.001.04. - zmianie ulega struktura, po przyjęciu transakcji repo w tych komunikatach pojawi się nowa sekcja <RpMktSttlmSafAcct>;
- ✓ komunikat sese.sts.002.02 - potwierdzenie przyjęcia transakcji do rozliczeń z rynku kasowego i terminowego. Struktura nie ulega zmianie, ale po przyjęciu transakcji repo w polu typ operacji <SttlmTxTp> będą przekazywane typy operacji 'REPU' lub 'RVPO';
- ✓ komunikat camt.smt.001.04 – zestawienie zobowiązań i należności wynikających z przyjętych transakcji w danym dniu. Struktura pozostaje bez zmian, natomiast w polu typ operacji <SttlmTxTp> pojawią się 'REPU' lub 'RVPO'.

Jednocześnie bez zmian pozostają komunikaty z obszaru Clearing w formacie ISO 20022, ich sposób wypełniania jest analogiczny jak w komunikacie sese.sts.002.02.

Wszystkie struktury komunikatów wraz z opisem umieszczone są na naszej stronie internetowej http://www.kdpwccp.pl/pl/Uczestnicy/Strony/zmiany_repo.aspx.

Równocześnie z dniem rozpoczęcia testów rozliczeń przyjmowanych z TBSP transakcji repo, jest też możliwość przeprowadzenia testów nowej usługi KDPW_CCP - zgłaszania za naszym pośrednictwem transakcji do Repozytorium Transakcji SFTR KDPW. Warunkiem zaraportowania przez KDPW_CCP transakcji repo jest delegowanie na KDPW_CCP obowiązku zgłaszania transakcji repo w imieniu uczestnika rozliczającego lub jego klienta. W celu zgłaszania zabezpieczeń klientów do repozytorium transakcji dla uczestników rozliczających zostały przygotowane komunikaty:

- ✓ auth.mrg.001.01 - rejestracja zabezpieczenia klienta;
- ✓ auth.sts.001.01 - status rejestracji zabezpieczenia klienta.

W razie pytań lub wątpliwości prosimy o kontakt z Zespołem Zarządzania Ryzykiem, tel. 22 537 93 74 lub z Zespołem Rozliczeń, tel. 22 537 94 79 lub poprzez e-mail: ccp@kdpw.pl. W szczególności liczymy na kontakt z Państwa strony w sprawie zestawienia scenariuszy testowych, które miałyby na celu przygotowanie Państwa systemów informatycznych do obsługi krok po kroku udostępnianych przez KDPW_CCP komunikatów oraz dałyby pełny obraz nowych wymagań związanych z obsługą transakcji repo zawieranych na TBSP.

Z poważaniem,

Marcin Truchanowicz
Dyrektor Zarządzający KDPW_CCP S.A.