

SCP/ZW/4/2023

Warszawa, 7 listopada 2023 r.

**Uczestnicy KDPW**

dot.: wdrożenia zmian w systemach informatycznych KDPW, w ramach jesiennego okna wdrożeniowego w terminie 18 - 19 listopada 2023 r.

Szanowni Państwo,

nawiązując do naszego pisma SCP/ZW/8/2022; CCP/ZW/655/2022 z 4 października 2022 r. zawierającego informacje o planach na 2023 r. związanych ze zmianami w systemach informatycznych KDPW i KDPW\_CCP, wynikających ze zmian w zakresie świadczonych usług lub zmian regulacyjnych, uprzejmie informujemy, że w terminie **18 - 19 listopada 2023 r.** w ramach jesiennego okna wdrożeniowego 2023, nastąpi:

- 1. Wdrożenie standardów AMI-SeCo w zakresie wymiany komunikatów ISO 20022 w ramach obsługi zdarzeń korporacyjnych oraz**
- 2. Wprowadzenie zmian w funkcjonalnościach procesu rozrachunku.**

**Ad. 1**

Zmiany systemowe będące przedmiotem wdrożenia zostały przygotowane w celu dostosowania KDPW do zasad obsługi zdarzeń korporacyjnych zgodnych z standardami AMI-SeCo (AMI-SeCo Standards for Corporate Actions) w ramach Single Collateral Management Rulebook for Europe (SCoRE).

W związku z zaplanowanym wdrożeniem od 20 listopada 2023 r. w KDPW obsługa zdarzeń korporacyjnych realizowana będzie za pomocą komunikatów ISO 20022 w najnowszej wersji.

Zakres implementowanych standardów SCoRE obejmuje harmonizację procesów i zasad obsługi zdarzeń korporacyjnych oraz zapewnienie spójności i kompletności danych o zdarzeniach korporacyjnych przekazywanych przez pośredników, w tym przez centralne depozyty papierów wartościowych

oraz podmioty prowadzące rachunki papierów wartościowych. Implementowane standardy odnoszą się także do szczegółowych reguł stosowanych w zakresie kalkulacji pożytków, w tym reguł ich zaokrąglania i terminów ich wypłaty, oraz zasad przekazywania informacji o realizacji praw z papierów wartościowych.

#### Materiały

Szczegółowe materiały dotyczące projektowanych zmian w systemach informatycznych KDPW, związanych z dostosowaniem do standardów AMI-SeCo przekazaliśmy Państwu pismami: z 8 kwietnia 2022 r. Nr BRB/ZW/7/2022, z 3 czerwca 2022 r. Nr BRB/ZW/13/2022, z 31 marca 2023 r. Nr BRB /ZW/5/2023, z 20 lipca 2023 r. Nr BRB/ZW/9/2023, z 29 września 2023 r. Nr BRB/ZW/12/2023 oraz 26 października 2023r. Nr BRB/ZW/16/2023.

#### Regulacje KDPW

Zmiany w Szczegółowych Zasadach Działania KDPW, związane ze sferą obsługi zobowiązań emitentów (tego obszaru zagadnień dotyczą następujące zmiany: nowy § 120c, zmiany § 126 i § 134, nowy § 134a, zmiany § 137, § 139, § 174a, § 174b, § 179, § 182 oraz zmiana w załączniku nr 1 dotycząca opisu statusu aktywów „BLRD” w Szczegółowych Zasadach Działania KDPW), wejdą w życie w dniu 20 listopada 2023 r., zostały opublikowane w dniu 6 listopada 2023 r. i są dostępne na stronie internetowej KDPW ([link](#)).

#### Testy

Uprzejmie przypominamy, że możliwość testowania zmian była udostępniana Państwu etapami, począwszy od dnia 27 lipca 2023 r.

#### Ad. 2

Wśród zmian wprowadzanych w funkcjonalnościach rozrachunku w szczególności należy wymienić:

- zmiany dot. znaczników kierunku przepływu papierów wartościowych oraz środków pieniężnych w komunikatach dotyczących procesu rozrachunku,
- mechanizm hold release dla transferów międzysystemowych,
- możliwość zmiany systemu rozrachunku (sesyjny-RTGS): MB->RTGS; RTGS->MB, w zakresie zestawionych zleceń rozrachunku,
- modyfikację w zakresie określania momentu naliczania kar pieniężnych CSDR (tzw. cut-off dla kar), będącej konsekwencją wprowadzenia możliwości zmiany systemu rozrachunku.

#### Materiały

Szczegółowe informacje dotyczące planowanych zmian w funkcjonalnościach procesu rozrachunku przekazaliśmy Państwu pismami: z dnia 21 kwietnia 2023 r. Nr DO/ZW/679/2023, z dnia 20 lipca 2023 r. Nr DO/ZW/1172/2023, z dnia 12 września 2023 r. Nr DO/ZW/1436/2023, z dnia 13 października 2023 r. Nr DO/ZW/1618/2023.

#### Regulacje KDPW

Zmiany w Szczegółowych Zasadach Działania KDPW, związane ze sferą rozrachunku dotyczą wprowadzenia mechanizmu hold-release w obszarze międzysystemowych transferów papierów wartościowych oraz wprowadzenia możliwości zmiany systemu, w którym ma zostać przeprowadzony rozrachunek transakcji, po zestawieniu dotyczących jej zleceń rozrachunku (tego obszaru zagadnień dotyczą zmiany dotychczasowych lub dodawane nowe postanowienia Szczegółowych Zasad Działania KDPW - § 32, § 33a, § 33b, § 33c, § 37), wejdą w życie z dniem 20 listopada 2023 r., zostały opublikowane w dniu 6 listopada 2023 r. i są dostępne na stronie internetowej KDPW ([link](#)).

Testy

Upzejmie przypominamy, że możliwość testowania zmian w procesie rozrachunku została udostępniona Państwu od dnia 18 września 2023 r.

Z poważaniem

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  
Urząd Komisji Nadzoru Finansowego