

CCP/ZW/81/2025

IT/ZW/2/2025

Warszawa, 31 marca 2025 r.

Uczestnicy KDPW

Uczestnicy KDPW\_CCP

**dot.: wdrożenia zmian w systemach informatycznych KDPW i KDPW\_CCP, w ramach wiosennego okna wdrożeniowego w terminie 12-13 kwietnia 2025 r.**

Szanowni Państwo,

nawiązując do naszego pisma SP/ZW/41/2024; CCP/ZW/697/2024 z dnia 8 października 2024 r. zawierającego informacje o planach na 2025 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 dniach **12-13 kwietnia 2025 r.** w ramach wiosennego okna wdrożeniowego 2025, nastąpi:

### 1. Implementacja nowych rozwiązań w zakresie obsługi WZ

Wdrożone zostaną zmiany dotyczące komunikatu ISO20022 seev.001.001.11 (MeetingNotification), polegające w szczególności na wprowadzeniu nowego oznaczenia metody udziału w walnym zgromadzeniu „VIRT”, które będzie stosowane w przypadku udostępnienia przez spółkę możliwości udziału w walnym zgromadzeniu za pośrednictwem aplikacji eVoting. Ponadto zmiany dotyczą wprowadzenia obsługi opcjonalnych elementów ww. komunikatu, mających zastosowanie w przypadku walnych zgromadzeń spółek zagranicznych.

#### Testy

Uprzejmie przypominamy, że możliwość testowania obsługi komunikatu seev.001.001.11 została udostępniona Państwu od początku lutego 2025 r.

#### Materiały

Szczegółowe materiały znajdują się na stronie internetowej [www.kdpw.pl](http://www.kdpw.pl) ([link](#)).

### 2. Wdrożenie nowej wersji standardu komunikatów FpML w usłudze rozliczeń OTC

Wdrożona zostanie najnowsza wersja 5.12 standardu komunikatów Financial products Markup Language (FpML), w miejsce obecnie stosowanej wersji 5.11.

### Testy

W środowisku testowym KDPW\_CCP, we wrześniu 2024 r., udostępniona została możliwość testowania procesów oraz przepływu ww. komunikatów dla uczestników KDPW\_CCP (obróć niezorganizowany).

### Materiały

Szczegółowe materiały znajdują się na stronie internetowej [www.kdpwccp.pl](http://www.kdpwccp.pl) ([link](#)).

### **3. Techniczne wprowadzenie nowych komunikatów systemowych do pozyskiwania informacji o spreadach bid-ask dla instrumentów pochodnych OTC na potrzeby obliczeń depozytu add-on LCRM**

Nastąpi techniczne wdrożenie nowych komunikatów do obsługi ankiet na potrzeby wyznaczania depozytów LCRM w obrocie OTC, zabezpieczających ryzyko płynności i koncentracji, tj. otcc.pll.001.01, otcc.plr.001.01, otcc.pls.001.01. Wdrożenie to nie wpłynie na procesy po stronie uczestników rozliczających oraz na poziom wymaganych przez KDPW\_CCP depozytów zabezpieczających, które będą nadal wyznaczone zgodnie z dotychczasowym modelem.

Wdrożenie zmian w pozostałym zakresie, dotyczącym modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających obejmie:

- a) wprowadzenie depozytu dodatkowego zabezpieczającego ryzyko płynności i koncentracji (LCRM);
- b) zastąpienie obecnego modelu IM - Expected Shortfall modelem Expected Shortfall wyznaczanym jako liniowa kombinacja dwóch komponentów: Expected Shortfall wyznaczonego dla scenariuszy historycznych wygenerowanych przy użyciu filtrowanej symulacji historycznej (*ES(FHS)*) oraz Expected Shortfall wyznaczonego dla zestawu scenariuszy skrajnych

i zakładamy, że nastąpi nie później niż do końca czerwca 2025 r. O konkretnym terminie wdrożenia poinformujemy odrębnym pismem, w pierwszej połowie maja 2025 r.

### Testy

Wymagane jest przeprowadzenie dodatkowych testów w zakresie ankietowania z udziałem wszystkich uczestników rozliczających w obrocie niezorganizowanym (OTC). O harmonogramie testów uczestnicy zostaną poinformowani odrębnym pismem.

### Materiały

Szczegółowe materiały znajdują się na stronie internetowej [www.kdpwccp.pl](http://www.kdpwccp.pl) ([link](#)).

Z poważaniem,

Rafał Wawrzyniak

Dyrektor Zarządzający ds. IT

#### 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