

Pojasnila o vprašanih s 4. sestanka skupine SI-NMPG

Tihana Ričković je predlagala, da vpeljemo v sporočila polje »Change In Beneficial Ownership« (npr. :22F::BENE//NBEN ali uporabo ISO Transaction Code PORT (Portfolio Move)). KDD bo proučil možnost in predlagal rešitev.

V poravnalne inštrukcije dodamo možnost uporabe :22F::BENE//NBEN (oziroma :22F::BENE//YBEN). Posledično se doda polje v SettlementInstruction in sicer BeneficialOwnershipIndicator (opcijsko), ter možnost vnosa tudi preko klienta. Če je v MT nalogu NBEN, se v polje BeneficialOwnershipIndicator zapiše NO, če v MT nalogu YBEN, potem dobi vrednost YES, sicer se ne pojavi v SettlementInstruction.

Polje se zabeleži v bazo, glede tega polja ni nobenih dodatnih kontrol. V T2S ga posredujemo samo pri neuparjenih inštrukcijah in sicer v polju BeneficialOwnership/Indicator (YES/NO), ter se napolni glede na zapis v CRVP. Informacijo dodamo tudi v WCF.

KDD bo ponovno proučil uporabo polja PSET za namen »counterparty's CSD BIC«.

Uporaba polja PSET v MT54x.

Polje PSET v inštrukcijah MT54x vedno vsebuje BIC kodo CSD-ja nasprotne strani. Za poravnavo inštrukciji v CRVP (in morebiti v T2S) je potrebno upoštevati dva scenarija:

- Intra-CSD inštrukcija - REAG (član kupca) in DEAG (član prodajalca) imata nakupni oz. prodajni račun odprti pri istem CSD-ju
- Cross-CSD inštrukcija - REAG in DEAG imata računa odprta pri različnih CSD-jih

V primeru Intra-CSD inštrukciji vsebuje polje PSET vedno BIC kodo KDD (tako v prodajni kot nakupni inštrukciji). V primeru Cross-CSD inštrukciji vsebuje polje PSET BIC kodo CSD-ja, pri kateremu ima odprt račun nasprotna stran.

Zgoraj opisano pravilo je predlagana s strani SMPG v dokumentu »Receiving Delivering Depository – PSET and PSAF Market Practice«. Istočasno je omenjeno pravilo skladno s tržno prakso določeno s strani drugih mednarodnih entitet (med drugimi Euroclear, OeKB, BNP Paribas).

KDD pojasni, kako se v CRVP vpiše imetnik dostavnega računa za namen avtokolateralizacije in katerega tipa je ta račun v CRVP. Ta račun je v T2S preslikan na način 1:1 brez restrikcij.

Imetnik dostavnega računa za namen centralno-bančne avtokolateralizacije je banka, ki je nasprotna stranka Banke Slovenije. Za dostavo kolaterala pri avtokolateralizaciji se lahko uporabljajo samo tisti računi VP bank, ki so v T2S preslikani na način »1:1 brez restrikcij« (t.j. v statičnih podatkih računov VP v T2S se bodo povezave z DCA računi za potrebe dostave kolaterala lahko ustvarile samo za račune 1:1 brez restrikcij).

KDD pojasni namen in vpliv CUM/EX indikatorja.

Opt-out (transaction condition indicator) se uporablja za zavrnitev (potencialnega) inštruiranjna Market claim ali transformiranja inštrukcije s strani Instruction owner CSD.

Če stranki posla ne želita inštruiranja Market claim ali transformacije viseče inštrukcije s strani CSD, uporabita indikator Opt-out v inštrukcijah (tj. označita polje). Če je v vsaj eni inštrukciji označen Opt-out, le to postane obvezno polje za uparjenje (uparjenje: opt-out z opt-out ali blank z blank). V CRVP je to obvezno polje brez prednastavljene vrednosti (blank pomeni potencialen vnos Market claim inštrukcije v skladu s CAJWG/CASG standardi). Opt-out indikator ima prioriteto pred Ex/Cum.

Ex/Cum indicator (transaction condition indicator) se uporablja, če stranki posla želita inštruiranje Market claim s strani Instruction owner CSD, vendar ne po standardnem postopku (v skladu z v distribuciji opredeljenim Ex-date (prvi dan trgovanja brez prejema upravičenj) in kakor opredeljeno s CAJWG/CASG standardi), temveč na podlagi označenega Ex ali Cum indikatorja. Na podlagi Ex/Cum indikatorja, CSD inštruira Market claim brez standardnega upoštevanja podatka o Ex-date. Ex indicator pomeni posel brez upravičenja in Cum posel z upravičenjem. Če je v vsaj eni inštrukciji označen Ex/Cum, le to postane obvezno polje za uparjenje (uparjenje: Ex z Ex, Cum z Cum ali blank z blank). Ex/Cum indicator se lahko uporabi samo za posle s papirji, pri katerih se v primeru izplačil opredeli Ex-date – tj. pri izplačilih dividend in ne tudi pri upravičenjih iz dolžniških papirjev.

Želja članov skupine je, da KDD poskrbi za podatek o DCA računu pri seznamu poravnanih poravnalnih inštrukcij zaradi uparjanja podatkov s plačilnimi nalogi.

V obstoječih spletnih storitvah za poravnalne inštrukcije (MemberSettlementInstructionsHistory in MemberSettlementInstructionsPending) bo pri DVP dodana informacija o DCA računu. Potrebno pa je predvideti še dodatno spletno storitev z inštrukcijami za borzo, KD (vključno s prevzemi), ki bi vključevala tudi informacije o DCA računih.

Skupina je predlagala, da KDD prouči kaj je glede na CAJWG standarde pri vnosu poravnalnih inštrukcij v CRVP najprimernejša prednastavljena vrednost za »Opt Out« (nastavljena na »Da« ali prazna). Ta indikator vpliva na izvedbo »Market Claim« funkcionalnosti.

Če strani posla ne želita izvedbe transformacije, uporabita indikator Opt-out v inštrukcijah. Če je v vsaj eni inštrukciji označen Opt-out, le to postane obvezno polje za uparjenje (Non-mandatory additional matching field). CSD inštrukcijo v tem primeru prekliče in je ne nadomesti s transformirano.

Če stranki posla ne želita inštruiranja Market claim, uporabita indikator Opt-out v inštrukcijah. Če je v vsaj eni inštrukciji označen Opt-out, le to postane obvezno polje za uparjanje (Non-mandatory additional matching field).

V CRVP Klientu je to obvezno polje (YES/NO) brez prednastavljene vrednosti (NO pomeni potencialen vnos Market claim inštrukcije). Opt-out indikator ima prioriteto pred Ex/Cum.

V MT nalogih je za to predvideno polje za izbiro Opt Out. Če polja ne bo v nalogu, je Op-out=false.

Dodatna razlaga: Če je v polju OptOut vrednost Da, potem potem nočeš Market Claim inštrukcij, če pa je prazno ali Ne, potem hočeš Market Claim inštrukcije.

V CRVP se inštrukciji uparita tudi, če v eni ni prisotno polje OptOut, v drugi pa je NO. Pri pripravi inštrukcije v T2S (sese.023) pa se polje predvideno za OptOut napolni samo, ko je YES.