

4. SESTANEK SLOVENSKE NACIONALNE SKUPINE ZA TRŹNO PRAKSO NA PODROČJU VREDNOSTNIH PAPIRJEV (NATIONAL MARKET PRACTICE GROUP - NMPG)

ZAPISNIK

Datum in čas: 21.11.2014
Kraj: Ljubljana
Vodja sestanka: Rok Šketa, KDD
Prisotni: KDD d.d.: Rok Šketa (vodja skupine), Jakub Gregorski, Mojca Avbreht
NLB d.d.: Tihana Ričković (namestnica vodje skupine)
UniCredit Banka Slovenija d.d.: Denis Palamar
SKB d.d.: Vojislav Kecojević
Raiffeisen Banka d.d.: Cvetka Vlašič

Spremembe standardov

Nadgradnjo sistema CRVP, ki podpira ISO 15022 sporočila in s tem domačo prakso, je KDD izvedla 9.11.2012. in se je pričela uporabljati dne 12.11.2012.

- SKLEP 1 Trenutno ni potrebe po večji spremembi tržne prakse uporabe ISO 15022 sporočil pri poravnavi vrednostnih papirjev.
- 2 Člani skupine preverijo v svojih bankah, ali bodo nadgradili sisteme za avtomatsko izmenjavo nalogov s KDD na standard ISO 20022 (zaradi internih zahtev ali zahtev svojih strank) in če, kdaj naj bi sprememba bila izvršena. V kolikor bi bila potrebna sprememba prakse, to čim prej sporočijo ostalim članom skupine.
- 3 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.

Aktivnosti pri vključitvi KDD v Target2Securities

KDD bo pričel uporabljati poravnalno platformo Target2Securities v letu 2017. Pri uporabi le te bodo potrebne prilagoditve ISO 15022 sporočil v okviru SI-SMPG standarda.

- SKLEP 4 Skupina se je seznanila s predstavitvijo KDD, ki opisuje področja prilagoditev in opis le teh.
- 5 KDD bo ponovno proučil uporabo polja PSET za namen »counterparty's CSD BIC«.
- 6 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.
- 7 KDD pojasni namen in vpliv CUM/EX indikatorja.
- 8 KDD bo v okviru vključevanja v T2S platformo sproti seznanjal člane skupine o podrobnostih posameznih prilagoditev.
- 9 Vpeljava standardov za korporacijske akcije bo sledila aktivnostim MIG in NUG skupin. Člani skupine predlagajo, da KDD v okviru obveščanja o KD



po CTM modelu predvidi posredovanje vseh relevantnih podatkov, ki so sicer tudi v MT sporočilih.

- 9 NLB je obvestila skupino, da bodo po vsej verjetnosti (glede na zahteve Clearstream-a) odprli DCA račun že v tretjem valu, skupaj z Ministrstvom za finance. Ta DCA račun bo v tretjem valu povezan na račun VP pri Clearstream-u, v četrtem valu pa ga povežemo še z računi VP v KDD.
- 10 Želja članov skupine je, da KDD poskrbi za podatek o DCA računu pri seznamu poravnanih poravnalnih inštrukcij zaradi uparjanja podatkov s plačilnimi nalogi.
- 11 Člani skupine preverijo, ali obstaja v tujini (Clearstream, Euroclear, SWIFT) že tržna praksa preslikave med MT sporočili in MX T2S sporočili, saj bi bilo smiselno, da se slovenska praksa čim bolj približa drugim zaradi učinkovitosti.
- 12 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.

Razno

Razprava o ostalih aktivnostih skupine.

- SKLEP 11 V septembru 2014 je bil izveden globalni sestanek SMPG skupine v Bostonu. Predstavljen je zapisnik sestanka.
- 12 Spletna stran www.smpg.info bo do 28.11.2014 prenovljena. Naslov bo ostal isti, tudi dokumenti bodo preneseni.
- 13 6.10. je večina evropskih trgov prešla na poravnavo T+2.
- 14 Zaradi projekta vključevanja KDD v T2S bodo naslednji sestanki skupine predvidoma aprila 2015, novembra 2015 in septembra 2016. Tako bi omogočili vsem članom skupine dovolj časa in informacij za prilagoditev zalednih aplikacij na spremembe zaradi T2S.

Zapisal:

Rok Šketa, KDD