



OZNAM

Bratislava, 19.6.2020

o zmene recyklačnej periódy pre spárované príkazy na vyrovnanie

Vážení klienti,

dovoľujeme si vás informovať, že v rámci implementácie T2S požiadavky na zmenu T2S_0691_URD začne byť od 5.10.2020 pre všetky spárované príkazy na vyrovnanie v T2S uplatňovaná úprava parametru pre ich automatické rušenie, keď hodnota tohto parametru sa zmení z neobmedzenej doby na 60 prevádzkových dní. Podobné automatické rušenie príkazov funguje už dnes v prípade, že príkaz je v systéme nespárovaný po dobu 20 prevádzkových dní. Týmto sa teda automatické rušenie rozšíri i na spárované príkazy.

Cieľom tejto úpravy je zníženie počtu spárovaných, ale nevyrovnaných príkazov na vyrovnanie v T2S. Nové pravidlá prinášajú jednotný postup a dohodu pre centrálnu depozitárku zúčastnenú v T2S a ich účastníkov, a to v záujme efektívneho fungovania vyrovnania transakcií s cennými papiermi. Táto úprava zároveň rešpektuje pravidlá finality vyrovnania, ktorá sa v rámci EÚ uplatňuje v zmysle Smernice Európskeho parlamentu a Rady 98/26/ES o konečnom zúčtovaní. Čo táto zmena znamená konkrétne? Že vyhodnocovací mechanizmus T2S, resp. informačného systému CDCP (ďalej len „IS CDCP“) začne pre každú transakciu (t.j. dva spárované príkazy) počítať počet prevádzkových dní medzi posledným relevantným dátumom a aktuálnym prevádzkovým dňom a v prípade, že výpočet dosiahne hodnoty 60, ku koncu prevádzkového dňa oba príkazy danej transakcie zruší bez možnosti následnej obnovy.

Pod posledným relevantným dátumom sa rozumie buď požadovaný deň vyrovnania alebo deň, kedy bola zaznamenaná posledná zmena stavu transakcie. Táto posledná zmena stavu transakcie nastane vtedy, ak sa zmení napríklad stav pozdržania, a to pre oba príkazy v rámci transakcie. To znamená, že zmena stavu pozdržania len v jednom z príkazov nebude stačiť k opätovnému naštartovaniu recyklačného obdobia 60 dní.

Z praktického hľadiska to pre komunitu účastníkov CDCP a ich klientov znamená, že zmena parametru sa začne uplatňovať na každý príkaz, ktorý bude v T2S/IS CDCP spárovaný a bez zmeny stavu v období od 14.7.2020 do 5.10.2020 s požadovaným dňom vyrovnania

14.7.2020 a menej (t.j. skorší dátum). Všetky transakcie splňujúce tieto podmienky budú predstavovať prvú množinu príkazov, ktoré budú ku koncu prevádzkového dňa 5.10.2020 automaticky zrušené.

Nové pravidlá budú premietnuté do pravidiel systému vyrovnania transakcií s cennými papiermi v rámci Prevádzkového poriadku CDCP.