

Warszawa, 28 maja 2015

Izba KDPW_CCP rozliczyła pierwsze transakcje z rynku międzybankowego

Izba KDPW_CCP rozliczyła pierwsze transakcje z rynku międzybankowego (OTC), denominowane w PLN, zawarte pomiędzy Citi Handlowy a mBankiem. Do gwarantowania i zawierania transakcji na tym rynku służy specjalnie dedykowany temu segmentowi moduł otc_clearing, stworzony przez KDPW_CCP we współpracy z największymi bankami w Polsce, operującymi na rynku międzybankowym.

- Zaletą rozliczania transakcji z rynku derywatów OTC przez izbę rozliczeniową typu CCP jest przede wszystkim bezpieczeństwo takiego rozwiązania i gwarancje rozliczenia zawartych transakcji, czemu służą funkcjonalności izby rozliczeniowej: przejęcie przez CCP roli strony każdej transakcji w wyniku nowacji, wielostopniowy system gwarantowania rozliczeń oraz systemy zarządzania ryzykiem – powiedziała Iwona Sroka, Prezes KDPW_CCP i KDPW.

Potrzeba uruchomienia usługi rozliczania derywatów OTC i transakcji repo była uwarunkowana zapisami Rozporządzenia EMIR, zgodnie z którym wszystkie transakcje OTC zawarte w instrumentach pochodnych należących do wskazanych przez ESMA klas instrumentów pochodnych podlegają obowiązkowi rozliczania w CCP posiadającym unijną autoryzację. KDPW_CCP uzyskała stosowną autoryzację 8 kwietnia 2014 r.

- Izba KDPW_CCP posiada już 14 uczestników w obszarze rozliczeń OTC, wśród których są największe i najbardziej aktywne na polskim rynku banki. Warto także podkreślić, że banki korzystają z systemu otc_clearing, mimo iż formalne obligo rozliczeniowe nie weszło jeszcze w życie – powiedziała Iwona Sroka, Prezes KDPW_CCP i KDPW.

Korzyści z rozliczania transakcji OTC poprzez izbę rozliczeniową dostrzegają same banki, które zaczęły rozliczać transakcje w KDPW_CCP:

Hans-Dieter Kemler, Wiceprezes Zarządu ds. Rynków Finansowych, mBank:

Rozliczanie płynnych i ważnych dla systemów finansowych instrumentów pochodnych zawieranych na rynku OTC poprzez centralne izby rozliczeniowe jest jednym z bardzo istotnych filarów reformy rynków finansowych i wkrótce będzie obowiązkowe także w krajach Unii Europejskiej. mBank, jako jeden z najbardziej aktywnych polskich banków w obrocie instrumentami pochodnymi od początku popierał pomysł utworzenia lokalnej izby, która byłaby skupiona na rozliczaniu instrumentów ważnych dla rynku krajowego i rozwijałaby swoje usługi w ścisłej współpracy z tym rynkiem. Mając na względzie zbliżającą się rekomendację nadzorczą centralnego rozliczania pochodnych na stopę procentową w PLN, wierzymy, że KDPW_CCP uda się zagospodarować zdecydowaną większość tych transakcji zawieranych między bankami polskimi, a w przyszłości – rozszerzyć grono uczestników o aktywne banki zagraniczne.

Maciej Kropidłowski, Wiceprezes Zarządu, Szef Sub-Sektora Rynków Finansowych, Citi Handlowy:

Cieszę się, że Citi Handlowy uczestniczy w tak ważnych wydarzeniach, bo do takich należy zaliczyć pierwszą transakcję z rynku międzybankowego jaka rozliczona właśnie została przez KDPW_CCP. Z sukcesem przeszliśmy i przetestowaliśmy to nowoczesne rozwiązanie, dzięki któremu liczba i wartość transakcji na rynku OTC w Polsce ma szansę znacząco się zwiększyć. Taka konstrukcja rozliczania transakcji sprzyja bowiem przejrzystości obrotu, a co za tym idzie korzystanie wpływa na wzrost zaufania na rynku międzybankowym. Citi Handlowy od lat pozostaje liderem rynku obrotu instrumentami pochodnymi i głęboko wierzymy, że wraz ze zwiększeniem roli KDPW_CCP w realizacji tego typu transakcji rozwój tego rynku nabierze tempa, na czym skorzystać powinni klienci korporacyjni, warszawska giełda i wreszcie polska gospodarka.

Transakcje zostały potwierdzone (tzw. confirmacja) na platformie MarkitWire, a następnie przekazane do rozliczenia w KDPW_CCP. - *MarkitSERV jest dostawcą rozwiązań confirmacyjnych, rozliczeniowych i innych usług pośrednictwa w łańcuchach operacji finansowych i dzięki swojemu rozwiązaniu MarkitWire dostarcza do KDPW_CCP potwierdzone transakcje zawarte przez banki – powiedział Alex Paidas, Director of Corporate Communications, Markit.*

KDPW_CCP prowadzi rozliczenia transakcji w instrumentach denominowanych w PLN dla następujących transakcji OTC:

- Forward na stopę procentową (Forward Rate Agreement)
- Swap stopy procentowej (Interest Rate Swap)
- Overnight Index Swap
- Basis Swap
- REPO i sell/buy-back (na polskich obligacjach skarbowych)

Po uzyskaniu przez KDPW_CCP autoryzacji w EUR, instrumenty FRA, IRS, OIS, oparte o stopy EURIBOR/EONIA będą również rozliczane w EUR. Jednocześnie w wyniku ww. procesu autoryzacji koszyk instrumentów finansowych rozliczanych przez KDPW_CCP zostanie wzbogacony o dłużne instrumenty finansowe, będące zbywalnymi papierami wartościowymi.

Ostatni kryzys finansowy spowodował duży spadek zaufania na rynku międzybankowym, czego efektem było m.in. znaczące zmniejszenie się liczby i wartości transakcji na rynku OTC. Zarówno instytucje finansowe, jak i regulatorzy zaczęli poszukiwać rozwiązań, które mogłyby ten rynek ustabilizować i uczynić bezpiecznym. Na spotkaniu grupy G-20 we wrześniu 2009 zdecydowano o konieczności wprowadzenia regulacji prawnych obligujących do standaryzowania produktów z rynku OTC oraz ich rozliczania poprzez izby rozliczeniowe typu CCP (centralny kontrpartner). Standardy stosowane przez izby rozliczeniowe pozwalają bowiem na przeniesienie ryzyka z wielu kontrpartnerów na jednego, jakim jest izba, która jednocześnie zarządza ryzykiem związanym z transakcjami.

Dodatkowych informacji udziela:

Dariusz Marszałek, Szef Zespołu ds. Promocji i marketingu KDPW, tel. 605 969 626

E-mail: dariusz.marszalek@kdpw.pl

Dorota Szostek-Rustecka, Dyrektor Biura Prasowego, tel. (0-22) 690 10 49

E-mail: dorota.szostekrustecka@citi.com

Marta Zalewska-Naser, Specjalista ds.kontaktów z mediami, tel. (0-22) 692 94 16

E-mail: marta.zalewskanaser@citi.com

Marta Wiszniewska, Specjalista ds.kontaktów z mediami, tel. (0-22) 692 90 52

E-mail: marta.wiszniewska@citi.com

Bank Handlowy w Warszawie SA to jedna z największych instytucji finansowych w Polsce, oferująca pod marką Citi Handlowy bogaty i nowoczesny asortyment produktów i usług bankowości korporacyjnej, inwestycyjnej i detalicznej. Bank Handlowy obsługuje 7,4 tys. klientów korporacyjnych i ok. 760 tys. klientów indywidualnych poprzez nowoczesne kanały dystrybucji oraz sieć 60 oddziałów. W skład grupy kapitałowej Banku wchodzi takie podmioty jak: Dom Maklerski Banku Handlowego i Handlowy Leasing. Przynależność do Citigroup, największej na świecie instytucji finansowej, zapewnia klientom Banku Handlowego dostęp do usług finansowych w ponad 100 krajach.

Citi (NYSE:C) to wiodąca globalna instytucja finansowa, mająca około 200 milionów klientów w ponad 140 krajach. Poprzez swoje dwie odrębne jednostki operacyjne: Citicorp i Citi Holdings, Citi obsługuje klientów indywidualnych, korporacyjnych, rządowych i instytucjonalnych zapewniając im bogaty wachlarz produktów i usług finansowych w zakresie bankowości detalicznej, bankowości korporacyjnej i inwestycyjnej, usług maklerskich i zarządzania aktywami. Dodatkowe informacje można uzyskać na stronie internetowej www.citigroup.com lub www.citi.com.