



Centrálny depozitár cenných papierov SR, a.s.

Realizácia CA na ECMS relevantných účtoch

Verzia 1.0

31.05.2024

Obsah

DEFINÍCIE POJMOV	3
POUŽITÉ SKRATKY	3
1. Účel dokumentu	4
2. Popis realizácie ECMS CA	4
2.1 Interné procesy v CDCP	4
2.2 Predpoklady vo vzťahu k NBS, vlastníkovi PLEDGE účtu a emitentovi	4
2.3 Realizácia CA z pohľadu CDCP, NBS a emitena	5
2.4 Vyhotovenie zoznamu majiteľov CP emitentom	6
2.5 Zaslание peňažných prostriedkov na RTGS DCA CDCP	7
2.6 Vrátenie platby emitentovi	7
2.7 Emailová komunikácia s emitentom	8

DEFINÍCIE POJMOV

ECMS relevantný účet	Držiteľský účet NBS (vrátane účtu pre autokolaterálové operácie); účty majiteľov zriadené pre centrálnu banku Eurosystemu, kde NBS plní funkciu korešpondenčnej centrálnej banky - tieto účty sú otvorené pod klientskym účtom NBS; PLEDGE účet.
PLEDGE účet	Účet majiteľa – banky, ktorý je vyhradený v prospech NBS ako záložného veriteľa.
Relevantné CP	CP akceptovateľné ako zábezpeka v úverových operáciách Eurosystemu emitované v EUR.
Správa CANO	Oznámenie o korporátnej udalosti.
Správa CAPA	Predbežná správa o výpočte nárokov z korporátnej udalosti.
Správa CACO	Správa o potvrdení pohybu hotovosti alebo cenných papierov na relevantných účtoch.

POUŽITÉ SKRATKY

CA	Korporátne udalosti
CDCP	Centrálne deponitár cenných papierov SR, a.s.
CP	Cenný papier
DCA	Účelový peňažný účet
ECMS	[Eurosystem Collateral Management System] - Európsky systém riadenia kolaterálov
IS CDCP	Informačný systém CDCP
NBS	Národná banka Slovenska

1. Účel dokumentu

Účelom dokumentu je popis procesu výplaty výnosov a splatenia menovitej hodnoty relevantných CP emitentom v prípade, že sú dané CP na konci rozhodného dňa vedené na ECMS relevantných účtoch (ďalej aj ako „ECMS CA“).

Dokument popisuje len aktivity medzi emitentom a CDCP a aktivity medzi CDCP a NBS. Aktivity medzi NBS a emitentom a aktivity medzi NBS a jej protistranami (v rámci ECMS) nie sú v dokumente uvedené.

2. Popis realizácie ECMS CA

2.1 Interné procesy v CDCP

CDCP eviduje v IS CDCP zoznam ECMS relevantných účtov. Udržiavanie tohto zoznamu je v kompetencii NBS a CDCP a je jedným zo základných predpokladov úspešnej realizácie ECMS CA.

CDCP eviduje zoznam relevantných CP¹, pri ktorých je emitentským centrálnym depozitárom a ktoré sú emitované výlučne v mene EUR. Vzhľadom k tomu, že CDCP nebude zabezpečovať realizáciu CA pre celú emisiu relevantných CP, tak tento zoznam slúži na zabezpečenie sledovania budúcich CA a ich registrovanie do IS CDCP. CDCP bude vychádzať z dostupných platných emisných podmienok príslušnej emisie. V prípade potreby doplnenia údajov CDCP kontaktuje emitenta prostredníctvom vopred dohodnutých kontaktov.

2.2 Predpoklady vo vzťahu k NBS, vlastníkovi PLEDGE účtu a emitentovi

Predpokladmi úspešnej realizácie ECMS CA sú:

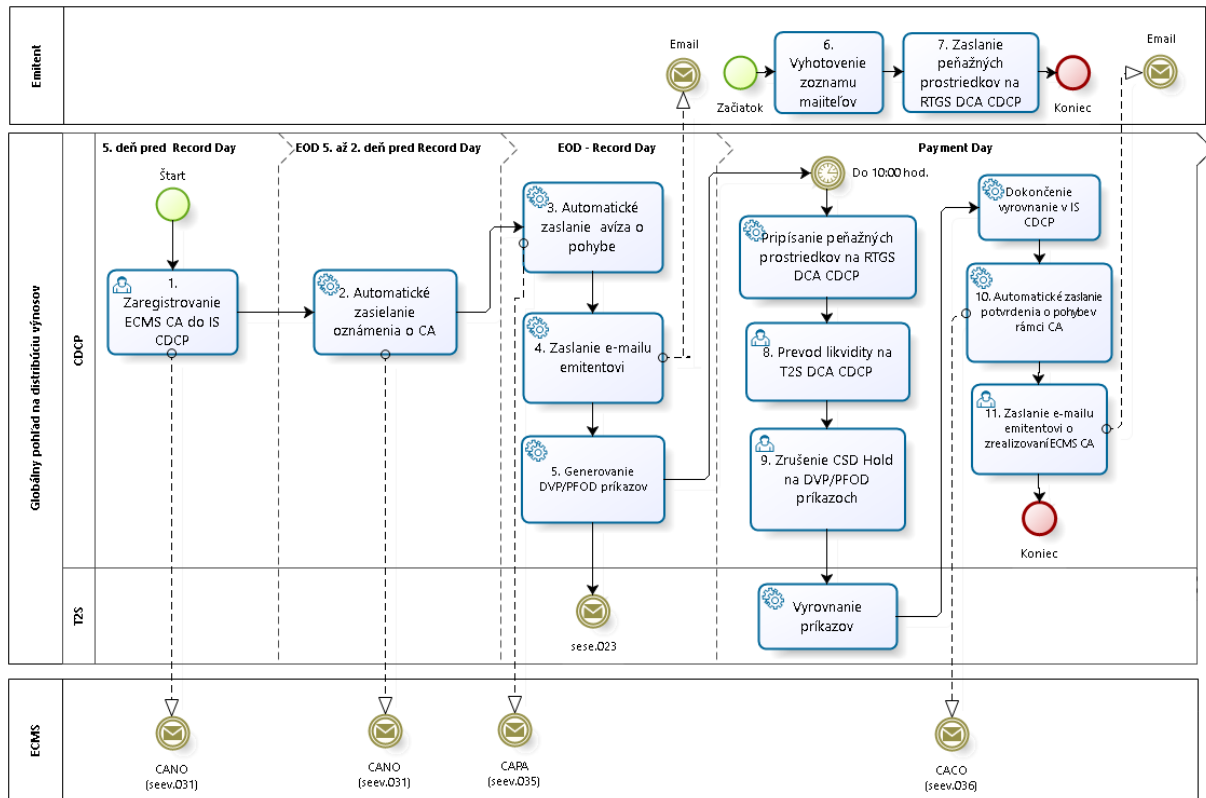
- a) NBS a vlastník PLEDGE účtu požiada emitentov o zasielanie zodpovedajúcich peňažných prostriedkov týkajúcich sa ECMS CA na RTGS DCA CDCP.
- b) NBS a vlastník PLEDGE účtu prelinkuje svoj účet CP na T2S DCA NBS určený pre spracovanie ECMS CA.
- c) Emitent vyhotoví **(spätný)** zoznam majiteľov ku koncu rozhodného dňa **so zohľadnením reštrikcie PLEDGE na vstupe** (pozri ods. 2.4 tohto bodu).
- d) Emitent zašle zodpovedajúce peňažné prostriedky na RTGS DCA CDCP do 10:00 hod. vo výplatnom dni (pozri ods. 2.5 tohto bodu).

¹ <https://www.ecb.europa.eu/mopo/coll/assets/html/index.en.html>

2.3 Realizácia CA z pohľadu CDCP, NBS a emitenta

Diagram procesu realizácie CA z pohľadu CDCP a NBS vrátane aktivít emitenta je znázornený na Obrázok 1. Aktivity a) až b) podľa ods. 2.2 tohto bodu nie sú v diagrame znázornené.

Obrázok 1: Realizácia ECMS CA z pohľadu CDCP a NBS



Popis aktivít:

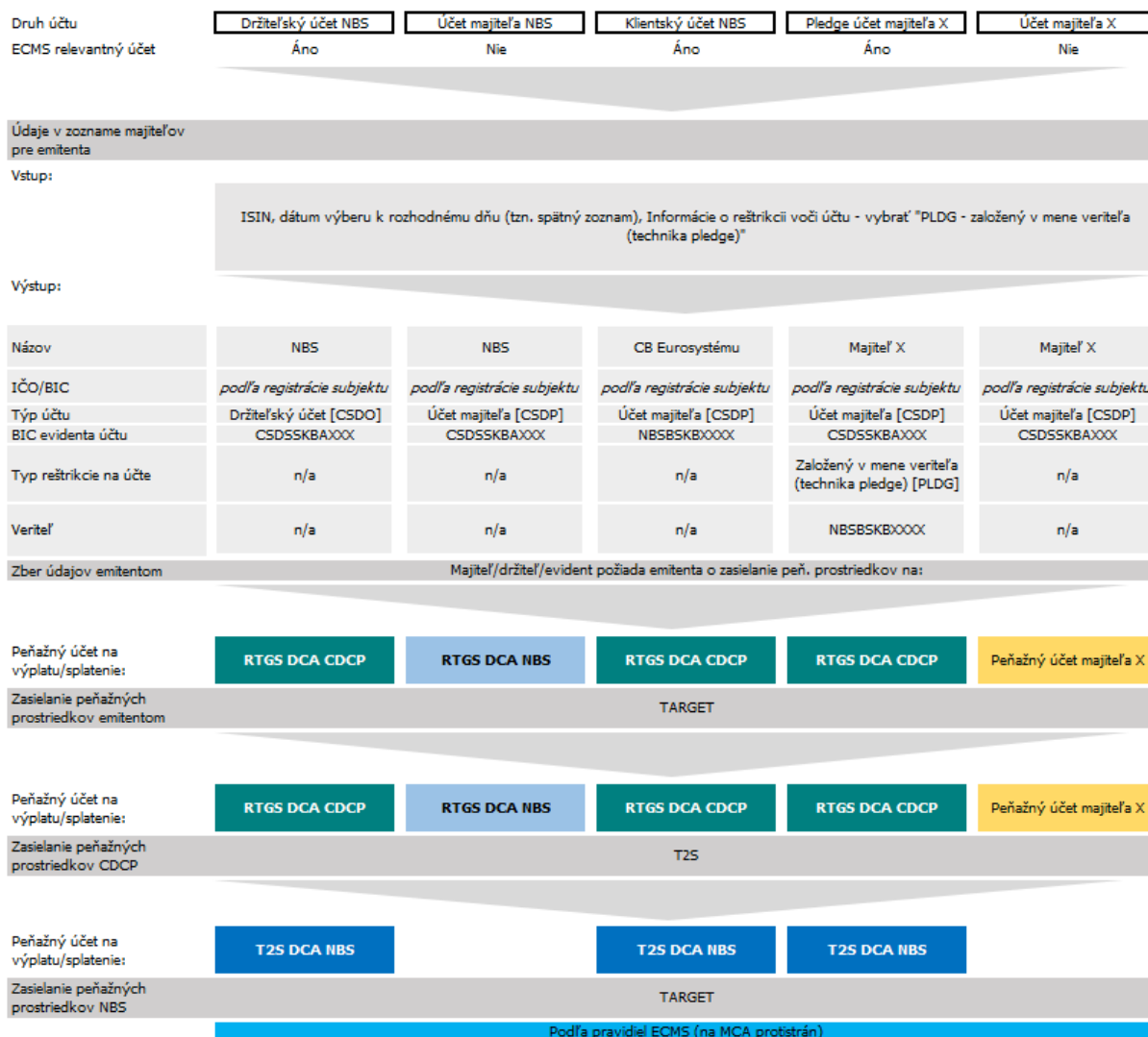
P. č.	Aktivita	Zodpovedný
1.	CDCP zaregistruje CA do IS CDCP 5 dní pred RD. Manuálna aktivita CDCP na základe udržiavania zoznamu relevantných CP.	CDCP
2.	CDCP zasiela správy CANO do ECMS 5 dní pred RD až do RD-1. Automatická aktivita IS CDCP.	CDCP
3.	CDCP zašle do ECMS správy CAPA na konci rozhodného dňa. Automatická aktivita IS CDCP.	CDCP
4.	CDCP zašle na konci rozhodného dňa emitentovi email s oznámením očakávaných platieb na svoj CDCP DCA účet. Automatická aktivita IS CDCP.	CDCP
5.	CDCP vygeneruje PFOD (ak INTR) alebo DVP (ak REDM) sese.023 v stave „CSD Hold“ (pozdržanie v mene CDCP). Automatická aktivita IS CDCP.	CDCP
6.	Emitent vyhotoví cez IS CDCP (spätný) zoznam majiteľov CP ku koncu rozhodného dňa a s uvedením reštrikcie PLDG (pozri ods. 2.4 tohto dokumentu).	Emitent
7.	Emitent zašle peňažné prostriedky cez pacs.008/009 do 10:00 hod. RTGS DCA CDCP.	Emitent
8.	CDCP prevedie peňažné prostriedky zo svojho RTGS DCA na svoj T2S DCA účet. Manuálna aktivita CDCP.	CDCP
9.	CDCP uvoľní sese.023 (zruší CSD hold). Manuálna aktivita CDCP.	CDCP

10.	Po vyrovnaní PFOD/DVP v T2S a IS CDCP zašle do ECMS správy CACO. Automatická aktivita IS CDCP.	CDCP
11.	Po vyrovnaní PFOD/DVP v T2S a IS CDCP zašle email emitentovi v ktorom potvrdí vyplatenie platieb. Manuálna aktivita CDCP.	CDCP

2.4 Vyhotovenie zoznamu majiteľov CP emitentom

Emitent vyhotoví zoznam majiteľov CP cez IS CDCP prostredníctvom služby owda.001. Plnenie vstupných a výstupných údajov a následný tok peňažných prostriedkov je znázornený na Obrázok 2.

Obrázok 2: Vyhotovenie zoznamu majiteľov



Mapovanie vybraných vstupných a výstupných údajov v rámci zoznamu majiteľov CP:

- Vstup – owda.001:

Vstupné údaje	Plnenie U2A/A2A v IS CDCP
Dátum rozhodného dňa	Dátum výberu Stmt/DtOrPrd/StmtDt/Dt/dátum a Stmt/ HistrData/true
Zohľadnenie reštrikcie PLEDGE v zozname majiteľov	Informácie o reštrikcii voči účtu - PLDG SchCrit/RtrSubBalTp/AcctRstrctn/Tp/PLDG

- Výstup – owda.002:

Výstupné údaje	Plnenie v xml
Údaje podľa Obrázok 2.	LstOwnrRspn/Bals/Bals/AcctOwnr/SbjIdDta/Comp/Nm = Názov LstOwnrRspn/Bals/Bals/AcctOwnr/SbjIdDta/Comp/IdNum = IČO LstOwnrRspn/Bals/Bals/AcctOwnr/SbjIdDta/Comp/BIC = BIC LstOwnrRspn/Bals/Bals/BalForAcct/AcctTp = Typ účtu LstOwnrRspn/Bals/Bals/AcctSvcr/BIC = BIC evidentna LstOwnrRspn/Bals/Bals/BalForAcct/SplmtryData/Envlp/AcctRstrctn/Tp = PLDG LstOwnrRspn/Bals/Bals/BalForAcct/SplmtryData/Envlp/AcctRstrctn/RspnsblSbjId = Veriteľ LstOwnrRspn/Bals/Bals/BalForAcct/SplmtryData/Envlp/AcctRstrctn/ActBhlfSbjId = Subjekt konajúci za veriteľa

2.5 Zaslание peňažných prostriedkov na RTGS DCA CDCP

Emitent zasiela zodpovedajúce peňažné prostriedky na RTGS DCA CDCP systéme TARGET-SK prostredníctvom platobných správ pacs.008 alebo pacs.009².

Platobné údaje CDCP:

BIC CDCP:	CSDSSKBAXXX
IBAN CDCP:	SK578191000000000045030
Variabilný symbol:	Podľa e-mailu vygenerovaného na konci rozhodného dňa.

2.6 Vrátenie platby emitentovi

Prípadné vrátenie peňažných prostriedkov emitentovi zrealizuje CDCP prostredníctvom svojho RTGS DCA v prospech účtu, z ktorého emitent zaslal CDCP peňažné prostriedky.

² Pri uvádzaní variabilného symbolu platí „Odporúčanie pre účastníkov systému TARGET-SK k spôsobu uvádzania niektorých náležitostí v platobných správach pre platobný systém TARGET-SK“ vydané NBS.

2.7 Emailová komunikácia s emitentom

CDCP zasiela emitentovi na dohodnuté e-mailové kontakty dva typy e-mailových správ:

- a) Informáciu o realizácii distribúcie peňažných prostriedkov v rámci ECMS CA.
- b) Potvrdenie o zrealizovaných platbách v rámci ECMS CA.