

Warszawa, 15 lipiec 2014 r.

Zasady raportowania aktualizacji wyceny i zabezpieczeń do
Repozytorium Transakcji KDPW

Spis treści

Wstęp	3
Raportowanie wyceny	4
Raportowanie zabezpieczeń.....	8
Raportowanie zbiorcze: klucze referencji, obsługa xml oraz interfejsowa	12
AKTUALIZACJA WYCENY	12
AKTUALIZACJA ZABEZPIECZEŃ.....	15

Wstęp

Niniejszy dokument opisuje zasady raportowania aktualizacji wyceny oraz zabezpieczeń do Repozytorium Transakcji prowadzonego przez KDPW.

Podmiotami zobowiązanymi do raportowania aktualizacji wyceny oraz zabezpieczeń są wszelkie podmioty finansowe (FC) oraz podmioty niefinansowe, które przekroczyły próg wiążący się z obowiązkiem rozliczania (NFC+) – art. 11 pkt. 2-4 rozporządzenia EMIR.

Aktualizacja wyceny oraz zabezpieczeń dokonywana w systemie KDPW_TR może zostać przekazana za pośrednictwem komunikatu podstawowego trar.ins.001.01 – wówczas aktualizacji podlegają dane tylko i wyłącznie dla danej transakcji.

Aktualizację wyceny dla danego produktu można przekazać zbiorczo za pomocą dedykowanego komunikatu trar.ins.002.01.

Aktualizację zabezpieczeń dla danego portfela można przekazać zbiorczo za pomocą dedykowanego komunikatu trar.ins.003.01.

Anulowanie komunikatu z aktualizacją wyceny i zabezpieczeń następuje poprzez przesłanie analogicznego komunikatu z rodzajem zmiany ‘error’ (AT=E) z wypełnioną sekcją Referencje. Oznacza to, że dla aktualizacji zgłaszanych komunikatem podstawowym trar.ins.001.01, anulowanie aktualizacji powinno zostać przekazane również komunikatem podstawowym trar.ins.001.01 z AT=E. W przypadku aktualizacji przekazywanych komunikatami zbiorczymi trar.ins.002.01 oraz trar.ins.003.01, anulowanie aktualizacji powinno zostać przekazane również komunikatami zbiorczymi odpowiednio – trar.ins.002.01 lub trar.ins.003.01 z AT=E z odwołaniem do SMR przekazanego w dedykowanym do anulacji komunikacie.

Poniższy dokument stanowi zbiór wskazówek dotyczących zasad raportowania oraz obsługi po stronie KDPW_TR poszczególnych scenariuszy raportowania aktualizacji wyceny oraz zabezpieczeń.

Objaśnienie stosowanych w dokumencie skrótów:

- ✓ Reporting timestamp - ReTm;
- ✓ Valuation timestamp – VITm;
- ✓ Eligibility Date – EG;
- ✓ Execution timestamp – EX.

Raportowanie wyceny

Uczestnik raportujący KDPW_TR może zgłosić wycenę kontraktu, na który zawarta jest transakcja z wykorzystaniem komunikatu podstawowego trar.ins.001.01 (AT=V) lub wycenę produktu, na który zawierany jest kontrakt za pomocą komunikatu trar.ins.002.01. Innymi słowy:

Wycena transakcji = wycena kontraktu * ilość kontraktów (pole Quantity);

Wycena kontraktu = wycena produktu Produkt definiowany jest w bazie RT przez klucz składający się z 4 pól: Taxonomy, Product1, Product2, Underlying, czyli jest to identyfikacja kontraktu na dany instrument bazowy.

1. Zgłoszenia wyceny kontraktu można dokonać komunikatem podstawowym trar.ins.001.01, dla rodzaju zmiany New (N) wypełniając sekcję 3.1, z zastrzeżeniem, iż EG musi być, co do daty, równa VITm. Jeśli EG nie jest, co do daty, równa z VITm to komunikat zostaje odrzucony.
2. Zgłoszenia lub aktualizacji wyceny kontraktu można dokonać modyfikując:
 - a. pojedynczą transakcję komunikatem trar.ins.00.01 – (AT=V), wypełniając sekcje 3;
 - b. potencjalnie wiele transakcji wysyłając wycenę produktu komunikatem zbiorczym trar.ins.002.01 (AT=V);
3. W trakcie zgłaszania wyceny w dedykowanym polu VITm odpisywana jest data i godzina wyceny. Jest to szczególnie istotne w przypadku wielokrotnego raportowania zmian wyceny na tą samą datę. Wówczas obowiązujące na dany dzień jest zgłoszenie z najpóźniejszą godziną zaraportowaną w polu VITm na dany dzień. Wszystkie zgłoszenia z wcześniejszą godziną VITm na dany dzień są nieobowiązujące, ale zachowywane w bazie RT. W praktyce oznacza to, iż dla wyznaczenia obowiązującego wyceny nie jest decydujący ReTm, jak to mam miejsce w przypadku innych rodzajów zmiany, lecz właśnie data i godzina wskazana w polu VITm.
4. Zgłoszenie wyceny komunikatem podstawowym (trar.ins.001.01 AT=V), której VITm jest równy VITm wcześniej zgłoszonej przez uczestnika za pomocą trar.ins.001.01 AT=V wycenie jest odrzucane.
5. Zgłoszenie wyceny zbiorczej, której VITm jest równy co do dnia i godziny VITm wcześniej zgłoszonej przez uczestnika wycenie zbiorczej jest odrzucane.

6. Priorytet wyceny zgłoszonej komunikatem trar.ins.001.01 AT=V jest wyższy niż wyceny zbiorczej, tzn. jeśli zgłoszono wycenę komunikatem podstawowym i zbiorczym na ten sam VITm to obowiązująca jest wycena zgłoszona komunikatem podstawowym, gdyż dotyczy ona wskazanej transakcji.
7. Każdy wpis wyceny zapisywany jest w bazie, nawet jeśli VITm tego zapisu jest wcześniejszy niż VITm jakiegokolwiek innej istniejącej już w bazie na daną datę wyceny.
8. Wycena zbiorcza (na produkt) zgłoszona na dany dzień jest przyporządkowana do wszystkich transakcji aktywnych na danym produkcie w danym dniu. Oznacza to, że wycena taka obejmuje również transakcje, które zostały zgłoszone po przyjęciu i przetworzeniu komunikatu trar.ins.002.01, tj. z późniejszym ReTm, o ile nie została do nich przypisana wycena z późniejszą godziną obowiązywania.
9. Wycena zgłoszona komunikatem zbiorczym (na produkt) jest przyjmowana, niezależnie od tego czy istnieją już jakiegokolwiek transakcje na produkt, którego wycena jest zgłaszana tym komunikatem zbiorczym.
10. Anulowanie wyceny następuje poprzez przesłanie AT=E odwołującego się do SMR komunikatu, którym przesłano wycenę. W przypadku przesłania AT=E do pojedynczego zgłoszenia wyceny (komunikat trar.ins.001.01 AT=E), usuwany jest jeden (bądź dwa, w przypadku AT=E dwustronnego) wpisy. W przypadku przesłania AT=E do wyceny przesłanej komunikatem zbiorczym (komunikat trar.ins.002.01 AT=E), usuwane są wszystkie wpisy o SMR zgodnym z SMR wyceny zbiorczej.
11. Anulowanie wyceny obowiązującej na dany dzień i godzinę powoduje jej usunięcie z danych prezentowanych publicznie i dostępnych dla uczestników. Jednocześnie, jeśli w bazie danych istnieją inne rekordy wyceny na daną datę, to wpis o najpóźniejszej godzinie wyceny (VITm) w danym dniu staje się widoczny dla uczestników i prezentowany publicznie. Po anulowaniu zgłoszenia wyceny, uczestnik może przesłać ponownie wycenę o tej samej co do dnia i godziny VITm.
12. Anulowanie transakcji, tzn. przesłanie AT=E do AT=N powoduje anulowanie całej historii transakcji, włącznie z wszystkimi AT=V przesłanymi do danej transakcji. AT=V zbiorcze nie zostają usunięte z bazy danych KDPW_TR, gdyż mogą dotyczyć także innych transakcji.

13. Po przyporządkowaniu wyceny produktu do transakcji (raportu) wycena kontraktu widoczna jest w interfejsie WWW i zwracana w wyniku zapytania trar.rqs.001.01.

14. W interfejsie WWW wycena kontraktu jest widoczna w zakładkach 'Searching and Reports download'i 'Archive'. Prezentowane są wartości 4 pól:

- Wycena kontraktu wg wartości rynkowej,
- Waluta wyceny,
- Data i godzina wyceny,
- Rodzaj wyceny.

Po wybraniu wartości w polu EG umieszczonego na górze ekranu, w tabeli prezentowane są dane dla transakcji obowiązujące na dzień EG oraz wycena obowiązująca na dzień EG.

15. W wyniku zapytania trar.rqs.001.01 uczestnik otrzymuje historię transakcji (w tym wyceny).

PRZYKŁAD:

Uczestnik raportuje kolejno:

- 1) Wycenę zbiorczą V1 na produkt P1, EG= D;
- 2) AT=N na produkt P1 bez wyceny, EX=D+5, EG=D+5;
- 3) AT=V (komunikatem podstawowym) V2, EG=D+5;
- 4) AT=V zbiorczo na produkt P1 V3, EG=D+7;
- 5) AT=V zbiorczo na produkt P1 V4, EG=D+8;
- 6) AT=M, EG=D+9;
- 7) AT=V (zbiorczo) V7, EG=D+11;
- 8) AT=C do AT=N, EG=D+10;

W interfejsie wybierając kolejne dni EG uczestnik widzi:

EG=D->D+4: nie widzi jeszcze transakcji

EG=D+5, AT=V, wycena V2

EG=D+6, AT=V, wycena V2

EG=D+7, AT=V, wycena V3

EG=D+8, AT=V, wycena V4

EG=D+9, AT=M, wycena V4

EG=D+10, zakładka Archive: AT=C, wycena V4;

EG=D+11, zakładka Archive: AT=C, wycena V4;

Po przesłaniu komunikatu trar.rqs.001.01 o historię tej transakcji w okresie D-D+10, uczestnik otrzymuje:

EG	AT	Wycena
D+5	V	V2
D+7	V	V3
D+8	V	V4
D+9	M	V4
D+10	C	V4

Raportowanie zabezpieczeń

Uczestnik raportujący KDPW_TR może zgłosić zabezpieczenie zawartej transakcji z wykorzystaniem komunikatu podstawowego trar.ins.001.01 (AT=N lub AT=V) lub zabezpieczenie całego swojego portfela (analitycznego bądź syntetycznego) za pomocą komunikatu trar.ins.003.01 (AT=V).

W bazie danych RT przechowywane są dwa pola dotyczące kodu portfela:

- ✓ Kod portfela analitycznego oraz
- ✓ Kod portfela syntetycznego.

Portfel syntetyczny może obejmować wiele portfeli analitycznych. Portfel analityczny może obejmować wiele transakcji.

1. Przekazując komunikat trar.ins.001.01 (AT=N, M) uczestnik może przekazać/zmienić kod portfela dot. transakcji w polu 2.4.9 Kod portfela zabezpieczeń.
2. Wysyłając komunikat trar.ins.001.01 (AT=V) uczestnik może podać kod portfela (analitycznego), którego dotyczy zabezpieczenie w polu 3.2.3 Kod portfela. Jednocześnie pole Zabezpieczenie na poziomie portfela powinno przyjąć wartość 'Y'. W przeciwnym przypadku komunikat jest odrzucany.
3. Pole 2.4.9 Kod portfela służy tylko do powiązania wycen zgłaszanych zbiorczo. Jeśli uczestnik raportując AT=V (trar.ins.001.01) podaje kod portfela inny niż podany w polu 2.4.9, to komunikat jest przyjęty i następuje aktualizacja pola Kod portfela związanego z wyceną, ale nie jest aktualizowane pole Kod portfela podane w sekcji 2.4. Podobnie, gdy raportując AT=V (trar.ins.001.01) raportujący podaje, że zabezpieczenie nie jest na portfel, następuje aktualizacja sekcji Zabezpieczenia, ale nie jest aktualizowane pole 2.4.9.
4. Wysyłając komunikat trar.ins.003.01 uczestnik raportuje zabezpieczenie portfela (analitycznego i ewentualnie syntetycznego). Pole 2.1 Kod portfela analitycznego jest obowiązkowe. Pole 2.2 Kod portfela syntetycznego jest opcjonalne. Jeśli podano wartość w polu 2.2 to oznacza to, że zabezpieczenie dotyczy portfela syntetycznego.

5. Wartość pola Kod portfela syntetycznego może być przekazana i zmieniona tylko komunikatem trar.ins.003.01. W AT=V (trar.ins.001.01) nie jest przekazywane pole Kod portfela syntetycznego. Oznacza to, że jeśli poprzednio obowiązujące zabezpieczenie było przekazane zbiorczo z podaniem portfela syntetycznego, to po przekazaniu AT=V na portfel analityczny, pole kod portfela syntetycznego będzie widoczne jako puste w bieżącej wycenie, a widoczne tylko w zabezpieczeniu przekazanym zbiorczo.
6. W zabezpieczeniu przekazanym zbiorczo uczestnik nie ma możliwości przekazania wartości pola Zabezpieczenie, gdyż dotyczy ono transakcji, a nie całego portfela. W celu zaraportowania nowej wartości lub zmiany wartości tego pola uczestnik może przestać AT=V komunikatem trar.ins.001.01. Uczestnik przesyłając trar.ins.001.01 AT=V, może zmienić w tej sekcji pole Zabezpieczenie i tylko to pole. Przy czym, wartości pozostałych pól tej sekcji (o ile nie są podane w AT=V trar.ins.001.01) nie są modyfikowane. W przypadku wyświetlenia tej sekcji w interfejsie www lub w komunikacie rqs widoczne są wszystkie ostatnio podane wartości tej sekcji, nawet jeśli nie były podane w AT=V trar.ins.001.01.
7. Przyporządkowanie zabezpieczenia zbiorczego (na portfel) odbywa się na zasadzie łączenia według pola Kod portfela analitycznego, tzn. pola 2.4.9 przekazanego w komunikacie trar.ins.001.01 z polem 2.1 z komunikatu trar.ins.003.01, tzn. zabezpieczenie zbiorcze przyporządkowywane jest do tych wszystkich raportów, które w polu 2.4.9 Kod portfela zabezpieczenia mają kod portfela zgodny z polem 2.1. Kod portfela analitycznego przekazywanym w zabezpieczeniu zbiorczym.
8. W przypadku wielokrotnego raportowania zmian zabezpieczenia na tą samą datę, obowiązujące na dany dzień jest zgłoszenie z najpóźniejszą godziną raportowania. Wszystkie wcześniejsze zgłoszenia na dany dzień są nieobowiązujące, ale zachowywane w bazie RT.
9. Zabezpieczenie zbiorcze (na portfel) zgłoszone na dany dzień przyporządkowywane jest do wszystkich transakcji aktywnych w danym dniu, dla których w polu Kod portfela wskazano kod identyczny z tym zgłoszonym w komunikacie zbiorczym. Oznacza to, że zgłoszenie takie obejmuje również transakcje, które zostały zgłoszone po przyjęciu i przetworzeniu komunikatu trar.ins.003.01, tj. z późniejszym ReTm, o ile nie została w nich wypełniona sekcja 3.2. dot. zabezpieczeń.

10. Zabezpieczenie zgłaszane komunikatem zbiorczym (na portfel) jest przyjmowane i zapisywane w bazie RT, niezależnie od tego czy istnieją już jakiegokolwiek transakcje z oznaczeniem portfela, którego zabezpieczenie jest zgłaszane tym komunikatem zbiorczym.
11. Anulowanie zgłoszonego zabezpieczenia następuje poprzez przesłanie AT=E odwołującego się do SMR komunikatu, którym przesłano zabezpieczenie. W przypadku przesłania AT=E do pojedynczego zgłoszenia zabezpieczenia (komunikat trar.ins.001.01 AT=E), usuwany jest jeden (bądź dwa, w przypadku AT=E dwustronnego) wpisy. W przypadku przesłania AT=E do zabezpieczenia przesłanego komunikatem zbiorczym (komunikat trar.ins.003.01 AT=E), usuwane są wszystkie wpisy o SMR zgodnym z SMR zbiorczego zabezpieczenia.
12. Anulowanie zabezpieczenia obowiązującego na dany dzień powoduje iż przestaje ono być publikowane i widoczne dla uczestnika. Jednocześnie, jeśli w bazie danych istnieją inne rekordy zabezpieczenia na daną datę, to wpis o najpóźniejszej dacie i godzinie raportowania (ReTm) w danym dniu staje się widoczny dla raportującego.
13. Po przyporządkowaniu zabezpieczenia portfela do transakcji (raportu) zabezpieczenie to widoczne jest w interfejsie WWW i zwracane w wyniku zapytania trar.rqs.001.01.
14. W interfejsie WWW zabezpieczenie transakcji widoczne jest w zakładkach 'Searching and Reports download' i 'Archive'. Prezentowane są wartości pól:
 - Zabezpieczenie,
 - Zabezpieczenie na poziomie portfela,
 - Kod portfela analitycznego,
 - Kod portfela syntetycznego,
 - Wartość zabezpieczenia,
 - Waluta wartości zabezpieczenia.

Po wybraniu wartości w polu EG umieszczonym na górze ekranu, w tabeli prezentowane są dane transakcji obowiązujące na dzień EG oraz obowiązujące na dzień EG zabezpieczenie.

W przypadku wartości zabezpieczenia przekazanych zbiorczo, pole Zabezpieczenie na poziomie portfela zawsze wypełniane jest wartością 'Y'.

15. W wyniku zapytania trar.rqs.001.01 uczestnik otrzymuje historię transakcji (w tym zabezpieczenia).

PRZYKŁAD:

Uczestnik raportuje kolejno:

- 1) Zabezpieczenie zbiorcze Z1 na portfel P1, EG= D;
- 2) AT=N, z podaniem portfela P1 bez zgłoszenia zabezpieczenia, EX=D+5, EG=D+5;
- 3) AT=V (komunikatem podstawowym) Z2, EG=D+5;
- 4) AT=V zbiorczo Z3 na portfel P1, EG=D+7;
- 5) AT=V zbiorczo Z4 na portfel P1, EG=D+8;
- 6) AT=M, EG=D+9;
- 7) AT=V (zbiorczo) Z7, EG=D+11;
- 8) AT=C do AT=N, EG=D+10;

W interfejsie wybierając kolejne dni EG uczestnik widzi:

EG=D→D+4: nie widzi jeszcze transakcji

EG=D+5, AT=V, zabezpieczenie Z2

EG=D+6, AT=V, zabezpieczenie Z2

EG=D+7, AT=V, zabezpieczenie Z3

EG=D+8, AT=V, zabezpieczenie Z4

EG=D+9, AT=M, zabezpieczenie Z4

EG=D+10, zakładka Archive: AT=C, zabezpieczenie Z4

EG=D+11, zakładka Archive: AT=C, zabezpieczenie Z4

Po przesłaniu komunikatu trar.rqs.001.01 o historię tej transakcji w okresie D-D+10, uczestnik otrzymuje:

EG	AT	Zabezpieczenie
D+5	V	Z2
D+7	V	Z3
D+8	V	Z4
D+9	M	Z4
D+10	C	Z4

Raportowanie zbiorcze: klucze referencji, obsługa xml oraz interfejsowa

AKTUALIZACJA WYCENY

W przypadku raportu zbiorczego z aktualizacją wyceny przypisanie wyceny przekazanej zbiorczo do wielu przekazanych/ przekazywanych do TR raportów o transakcjach pochodnych następuje tylko i wyłącznie w przypadku zgodności danych występujących w polach definiujących produkt (klucz produktu):

- ✓ taksonomia (Txnm),
- ✓ kod identyfikacyjny produktu nr 1 (PrdctId1),
- ✓ kod identyfikacyjny produktu nr 2 (PrdctId2),
- ✓ instrument bazowy (Undrlyg).

Oznacza to, że budując zbiorczy komunikat xml (trar.ins.002.01) z aktualizacją wyceny w sekcji 2.1.2 (Identyfikacja produktu), określony zostaje produkt, którego dotyczy aktualizacja wyceny. W procesie przetwarzania takiego komunikatu, system KDPW_TR napotykać transakcje zaraportowane dla tego klucza produktu, do każdej transakcji na tym produkcie dopisuje aktualizację wyceny zgodną z przekazanym komunikatem xml. Potencjalnie oznacza to aktualizację wielu raportów za pomocą jednego komunikatu. Zakładając, że zaraportowaliśmy 10.000 transakcji pochodnych na zboże wskazując, jako klucz produktu zestaw danych:

- ✓ E,
- ✓ CO,
- ✓ OT,
- ✓ zboze,

przekazując wycenę zbiorczo za pomocą jednego komunikatu/ wypełniając jedną formatkę interfejsową, aktualizacji poddajemy 10.000 naszych raportów. W przypadku aktualizacji wyceny indywidualnie należy dokonać 10.000 aktualizacji pojedynczych – tj. przekazać 10.000 komunikatów pojedynczych (trar.ins.001.01) lub aktualizować ręcznie w interfejsie 10.000 rekordów.

Przykładowy plik xml trar.ins.002.01

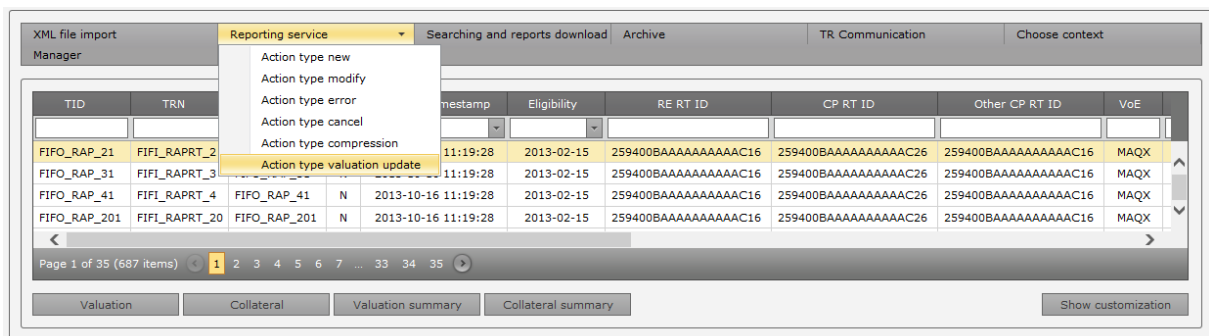
```

<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<KDPWDocument xmlns:xsd="http://www.w3.org/2001/XMLSchema"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  Sndr="RZ16" Rcvr="R001" xmlns="urn:kdpw:xsd:trar.ins.002.01">
  <trar.ins.002.01>
    <GnlInf>
      <TRRprtId>
        <Id>259400BAAAAAAAAAAC16</Id>
        <Tp>LEIC</Tp>
      </TRRprtId>
      <SndrMsgRef>SMR_KP20140711</SndrMsgRef>
      <FuncOfMsg>NEWM</FuncOfMsg>
      <ActnTp>V</ActnTp>
      <CreDtM>
        <DtM>2014-07-11T00:00:00</DtM>
      </CreDtM>
      <EligDt>2014-07-09</EligDt>
      <DtlLvl>S</DtlLvl>
    </GnlInf>
    <ValtnDtls>
      <CtrPtyAndPrdctInf>
        <CtrPtyInf />
        <PrdctInf>
          <Txnm>E</Txnm>
          <PrdctId1>CO</PrdctId1>
          <PrdctId2>OT</PrdctId2>
          <Undrlyg>zboze</Undrlyg>
        </PrdctInf>
      </CtrPtyAndPrdctInf>
      <ValtnInf>
        <MtMVal>152.32</MtMVal>
        <Ccy>PLN</Ccy>
        <ValtnDtM>2014-07-09T00:00:00</ValtnDtM>
        <ValtnTp>O</ValtnTp>
      </ValtnInf>
    </ValtnDtls>
  </trar.ins.002.01>
</KDPWDocument>

```

Aktualizacji zbiorczej można dokonać tak za pomocą zbiorczego komunikatu xml, jak i posługując się interfejsem, zakładką ‘Reporting service – action type valuation update – Valuation summary’.

Rysunek 1



Po wybraniu w dolnym panelu wyboru opcji ‘Valuation summary’, na ekranie, który się wyświetla należy wypełnić pola oznaczone, jako obowiązkowe – identyfikator komunikatu, datę obowiązywania zmiany, taksonomię produktu (pola: taxonomy, Product ID 1, Product ID 2, Underlying) oraz dane nt. wyceny – wartość wyceny, walutę wyceny, rodzaj wyceny oraz datę wyceny.

Rysunek 2

Reporting			
Reporting Entity RT ID	259400BAAAAAAAAAAC16	Reporting Entity RT ID Type	Legal Entity Identifier
Sender Message Reference		Reporting Timestamp	11/07/2014 14:54:36
Previous Sender Message Reference		Eligible Date	
Backloading			

Valuation details			
CP RT ID		CP RT ID	
Clearing Member ID		Clearing Member ID Type	
Taxonomy		Underlying	
Product 1 ID		Product 2 ID	
Mark to market Value		Currency	
Valuation Date		Valuation Type	

Save

Po wypełnieniu danymi:

Reporting			
Reporting Entity RT ID	259400BAAAAAAAAAAC16	Reporting Entity RT ID Type	Legal Entity Identifier
Sender Message Reference	SMR1	Reporting Timestamp	11/07/2014 15:39:44
Previous Sender Message Reference		Eligible Date	07/07/2014
Backloading			

Valuation details			
CP RT ID		CP RT ID	
Clearing Member ID		Clearing Member ID Type	
Taxonomy	Interim taxonomy	Underlying	zboze
Product 1 ID	CO	Product 2 ID	OT
Mark to market Value	514.2	Currency	USD
Valuation Date	11/07/2014 07:30:00	Valuation Type	Mark to market

Save

W efekcie tak zbudowanej aktualizacji system dokona aktualizacji wszystkich zdefiniowanych za pomocą klucza produktu raportów o wprowadzoną wartość wyceny.

Potwierdzeniem przyjęcia aktualizacji do przetworzenia jest komunikat trar.sts.002.01 udostępniany w kanale, z jakiego system otrzymał komunikat trar.ins.002.01 – dla obsługi w interfejsie komunikat zwrotny widoczny jest w zakładce 'TR Communication', dla obsługi A2A komunikat zwrotny udostępniany jest na serwer.

AKTUALIZACJA ZABEZPIECZEŃ

W przypadku raportu zbiorczego z aktualizacją zabezpieczeń przypisanie zabezpieczenia przekazanego zbiorczo do wielu przekazanych/ przekazywanych do TR raportów o transakcjach pochodnych następuje tylko i wyłącznie w przypadku zgodności danych występujących w polu definiującym kod portfela.

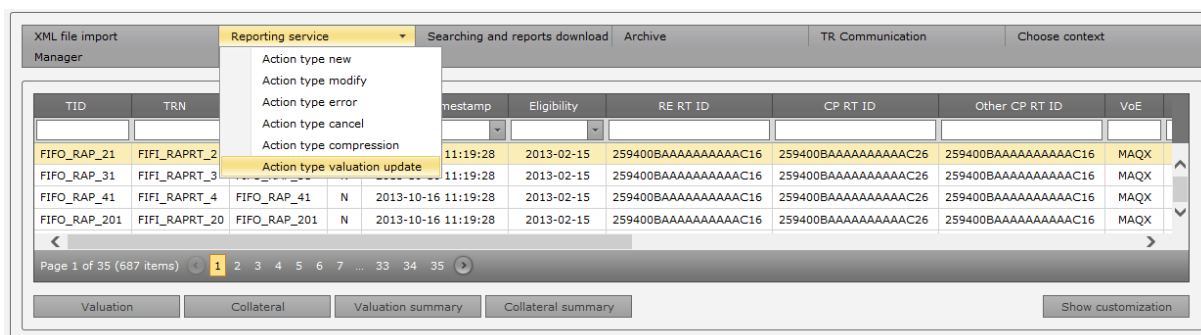
Oznacza to, że budując zbiorczy komunikat xml (trar.ins.003.01) z aktualizacją zabezpieczenia w sekcji 2 (Charakterystyka zabezpieczenia), określony zostaje portfel, którego dotyczy aktualizacja zabezpieczenia i co do wartości musi być równy portfelowi przekazanemu w polu 2.4.9 (Prtfld) komunikatu podstawowego trar.ins.001.01. W procesie przetwarzania takiego komunikatu, system KDPW_TR napotykając transakcje zaraportowane dla tego portfela, do każdej transakcji z tym portfelem dopisuje aktualizację zabezpieczenia zgodną z przekazanym komunikatem xml. Potencjalnie oznacza to aktualizację wielu raportów za pomocą jednego komunikatu. Zakładając, że zaraportowaliśmy 5.000 transakcji pochodnych na zboże wskazując w polu 2.4.9 kod portfela zabezpieczeń = 123456, przekazując aktualizację zabezpieczeń zbiorczo za pomocą jednego komunikatu/ wypełniając jedną formatkę interfejsową, aktualizacji poddajemy 5.000 naszych raportów. W przypadku aktualizacji zabezpieczeń indywidualnie należy dokonać 5.000 aktualizacji pojedynczych – tj. przekazać 5.000 komunikatów pojedynczych (trar.ins.001.01) lub aktualizować ręcznie w interfejsie 5.000 rekordów.

Przykładowy plik xml trar.ins.002.01

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<KDPWDocument xmlns:xsd="http://www.w3.org/2001/XMLSchema"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
  Sndr="RZ16" Rcvr="R001" xmlns="urn:kdpw:xsd:trar.ins.003.01">
  <trar.ins.003.01>
    <GnlInf>
      <TRRprtId>
        <Id>259400BAAAAAAAAAAC16</Id>
        <Tp>LEIC</Tp>
      </TRRprtId>
      <SndrMsgRef>SMR123</SndrMsgRef>
      <FuncOfMsg>NEWM</FuncOfMsg>
      <ActnTp>V</ActnTp>
      <CreDtIm>
        <DtIm>2014-07-11T00:00:00</DtIm>
      </CreDtIm>
      <EligDt>2014-07-11</EligDt>
      <DtLvl>S</DtLvl>
    </GnlInf>
    <CollDtls>
      <APrtfId>123456</APrtfId>
      <CollVal>56200.25</CollVal>
      <CollCcy>PLN</CollCcy>
    </CollDtls>
  </trar.ins.003.01>
</KDPWDocument>
```

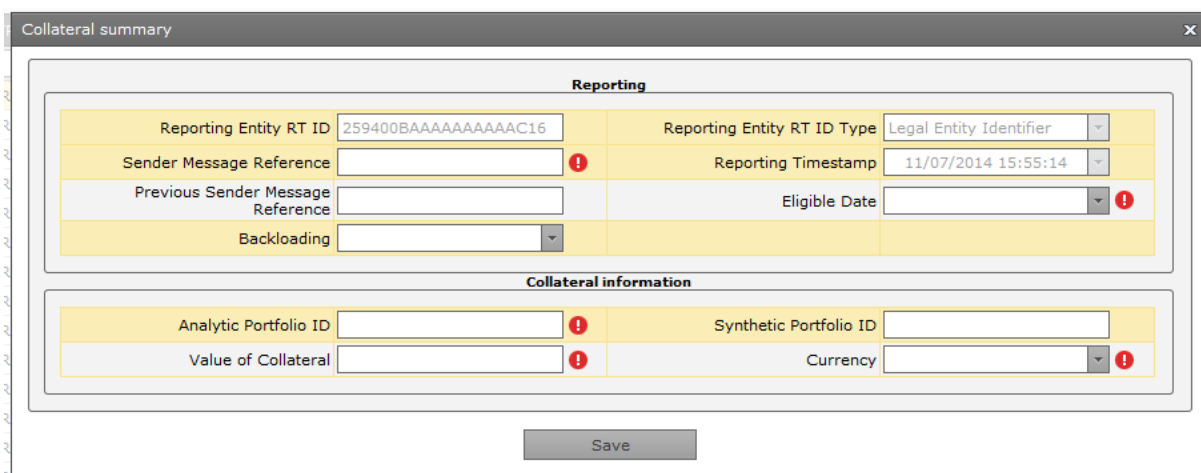
Aktualizacji zbiorczej można dokonać tak za pomocą zbiorczego komunikatu xml, jak i posługując się interfejsem, zakładką 'Reporting service – action type valuation update – Collateral summary'.

Rysunek 1

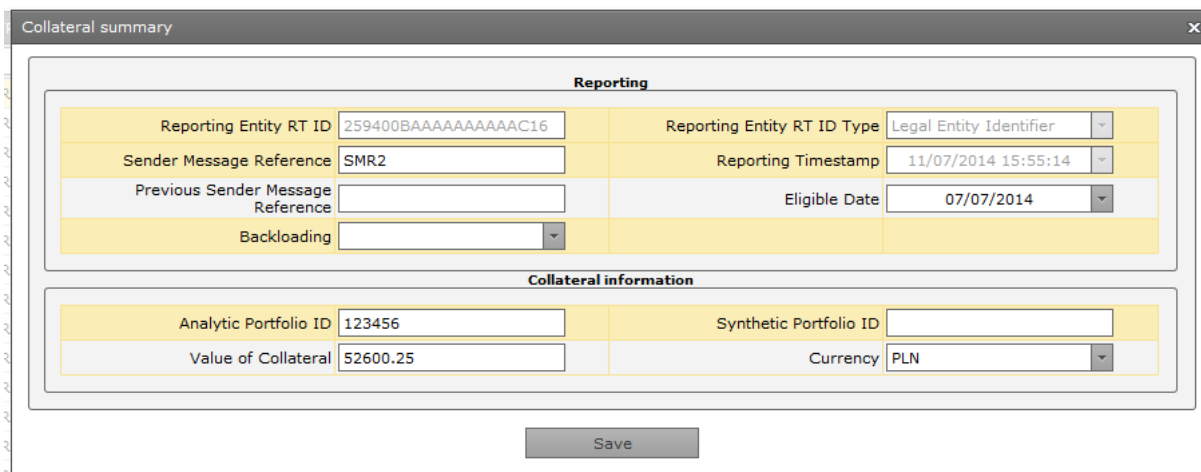



Po wybraniu w dolnym panelu wyboru opcji ‘Collateral summary’, na ekranie, który się wyświetla należy wypełnić pola oznaczone, jako obowiązkowe – identyfikator komunikatu, datę obowiązywania zmiany, portfel (analytic portfolio ID), wartość zabezpieczenia (value of collateral) oraz walutę zabezpieczenia (currency).

Rysunek 2



Po wypełnieniu danymi:





W efekcie tak zbudowanej aktualizacji system dokona aktualizacji wszystkich zdefiniowanych za pomocą portfela (123456) raportów o wprowadzoną wartość zabezpieczenia.

Potwierdzeniem przyjęcia aktualizacji do przetworzenia jest komunikat trar.sts.002.01 udostępniany w kanale, z którego system otrzymał komunikat trar.ins.003.01 – dla obsługi w interfejsie komunikat zwrotny widoczny jest w zakładce ‘TR Communication’, dla obsługi A2A komunikat zwrotny udostępniany jest na serwer.