

Techniczne instrukcje dotyczące raportowania

Zgłaszanie transakcji zgodnie z MiFIR

26 października 2016 r. | ESMA/2016/1521

Spis treści

1	Wstęp	3
1.1	Wprowadzenie	3
1.2	Kontekst projektu.....	3
1.3	Zakres niniejszego dokumentu	5
2	Ogólny proces	6
3	Obsługa błędów.....	9
3.1	Informacje ogólne	9
3.2	Błędy formalne	10
3.3	Błędy merytoryczne.....	11
4	Proces anulacji	16
4.1	Aktualizacja rekordu.....	16
4.2	Rekordy anulacji w schemie XML	16
4.3	Cykl życia raportów o transakcjach.....	17
5	Techniczne protokoły zbierania danych od podmiotów zgłaszających.....	20
6	Komunikaty ISO 20022	21
6.1	Informacje ogólne.....	21
6.2	Komunikat o dacie transakcji	22
6.3	Komunikat o statusie / komunikat zwrotny	22
6.4	Nagłówek Business Application Header	36
6.5	Nagłówek pliku merytorycznego.....	36
7	Załączniki.....	51
7.1	Załącznik nr 1.....	51
	Zasady walidacji danych	51
7.2	Załącznik nr 2	51
	Schemy komunikatów	51

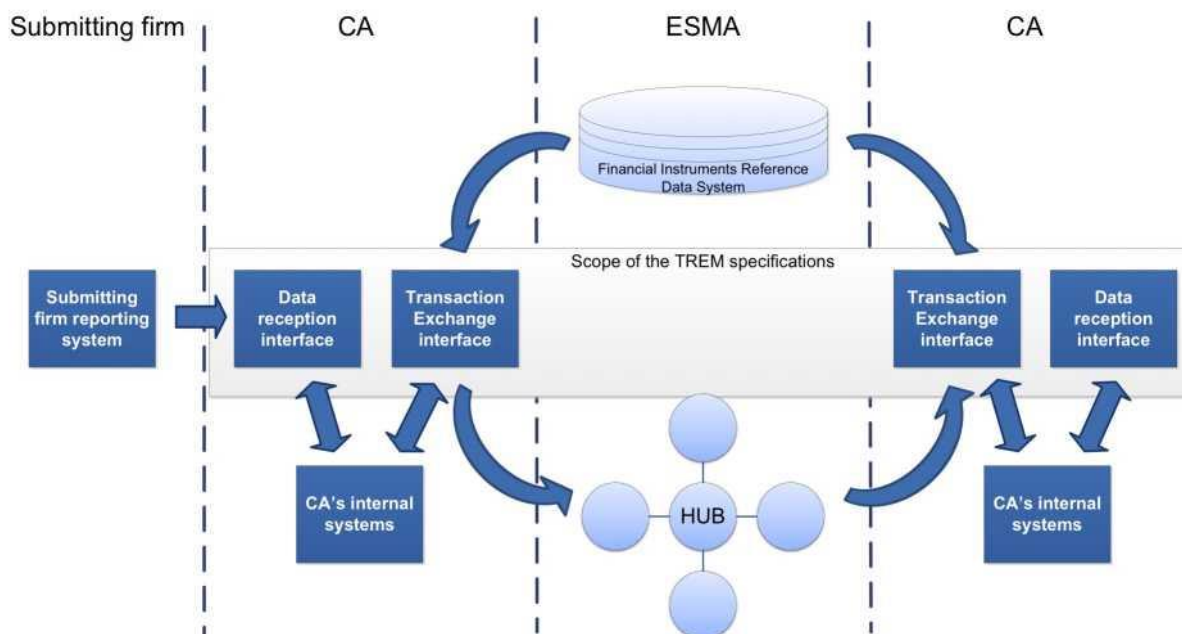
1 Wstęp

1.1 Wprowadzenie

1. Dyrektywa MiFID została wprowadzona celem stworzenia równego pola gry dla firm finansowych w całym Europejskim Obszarze Gospodarczym. Dyrektywa wywarła wpływ na krajowych regulatorów w bardzo szerokim zakresie, między innymi wskutek zmian wymogów dotyczących przyjmowania i dystrybucji raportów o transakcjach.
2. Po wdrożeniu MiFID, regulatorzy zobowiązani byli do zebrania raportów o transakcjach nie tylko od krajowych firm inwestycyjnych i krajowych podmiotów zależnych firm zagranicznych, ale również od oddziałów firm inwestycyjnych spoza UE z siedzibą na terytorium ich jurysdykcji. Regulatorzy przyjmujący takie raporty byli zobowiązani do przekazania niektórych ich elementów w uzgodnionym formacie do innych kompetentnych władz.
3. W listopadzie 2007 r. Komitet Europejskich Regulatorów Rynku Papierów Wartościowych (CESR) wdrożył system informatyczny wspierający wymianę raportów o transakcjach pomiędzy regulatorami. System ten, funkcjonujący pod nazwą Mechanizmu Wymiany Raportów o Transakcjach (ang. *Transaction Reporting Exchange Mechanism - TREM*), został stworzony w oparciu o specyfikacje określone w rozporządzeniu (WE) 1278/2006 wdrażającym MiFID w celu zorganizowania wymiany raportów o transakcjach pomiędzy europejskimi regulatorami finansowymi. System TREM początkowo ograniczał się do zakresu rozporządzenia określającego środki na poziomie 2 do MiFID, tj. do wymiany raportów o transakcjach, których przedmiotem są instrumenty dopuszczone do obrotu w Europie. W kolejnych latach został on poszerzony o transakcje, których przedmiotem są instrumenty pochodne znajdujące się w obrocie giełdowym (ETD) oraz instrumenty pochodne znajdujące się w obrocie niezorganizowanym (OTC).
4. Wprowadzenie rozporządzenia MiFIR w 2014 r. poszerza wymogi w zakresie raportowania transakcji pod względem zakresu instrumentów będących przedmiotem transakcji, które podlegają obowiązkowi zgłaszania, jak również zakresu informacji zgłaszanych w przypadku każdej transakcji. Szczegółowe informacje na temat reżimu raportowania transakcji określono w regulacyjnych standardach technicznych (RTS) dotyczących zobowiązań raportowych zgodnie z art. 26 MiFIR.
5. Ponadto MiFIR stanowi akt prawny wprowadzający maksymalną harmonizację, co oznacza, że w odróżnieniu od MiFID wszystkie państwa członkowskie powinny przestrzegać zasad określonych dla poziomu 1 i poziomu 2 bez prawa do jakiegokolwiek krajowej swobody decyzyjnej w kwestii wdrażania.
6. Na posiedzeniu w marcu 2015 r. Rada Organów Nadzoru ESMA (Europejski Organ Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych) podjęła decyzję, zgodnie z którą ESMA opracuje wspólną specyfikację raportowania transakcji dla kompetentnych władz i podmiotów zgłaszających. W związku z powyższym, niniejszy dokument obejmuje elementy interfejsu, który należy wprowadzić pomiędzy władzami właściwymi a uczestnikami rynku w ich państwach członkowskich. Dotyczy to w szczególności wspólnego formatu technicznego raportowania transakcji oraz wspólnego zbioru zasad zapewniania jakości danych.

1.2 Kontekst projektu

7. Na poniższym wykresie przedstawiono kontekst oraz kluczowe logiczne elementy składowe raportowania transakcji i architektury wymiany danych.



Legenda:

Submitting firm – Firma zgłaszająca

CA – Władza właściwa

ESMA – Europejski Organ Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych

Financial Instruments Reference Data System – System Danych Referencyjnych Instrumentów Finansowych

Scope of the TREM specifications – Zakres specyfikacji system TREM

Submitting firm reporting system – System raportowania firmy zgłaszającej

Data reception interface – Interfejs do odbioru danych

Transaction Exchange interface – Interfejs transakcji Giełdy

CA's internal systems – Systemy wewnętrzne władzy właściwej

HUB – Węzeł

8. Ogólny system raportowania transakcji składa się na następujących elementów logicznych:

- a. Każdy podmiot zgłaszający zobowiązany jest wdrożyć **system raportowania**, w którym raporty o transakcjach będą przygotowywane i przekazywane do władz właściwych w odpowiednim formacie.
- b. Władze właściwe zobowiązane są wdrożyć **interfejs do odbioru danych**, za pomocą którego odbierane będą dane od podmiotów zgłaszających. Taki interfejs ma zapewnić walidację zgodności raportów o transakcjach ze wspólnym formatem i wspólnymi zasadami walidacji, a także przekazywanie informacji zwrotnych podmiotom zgłaszającym.
- c. **Interfejs wymiany raportów o transakcjach (TREM)**: ten element ma wdrażać wspólny zbiór zastaw w zakresie wymiany raportów o transakcjach pomiędzy władzami właściwymi. Format danych i zasady walidacji powinny być analogiczne, jak w przypadku danych raportowanych przez podmioty zgłaszające (z wyjątkiem drobnych różnych technicznych).
- d. W zależności od potrzeb, władze właściwe mogą również stworzyć **systemy wewnętrzne**, przechowujące i analizujące otrzymane dane o transakcjach. Zagadnienie to wykracza poza zakres niniejszego dokumentu.
- e. **Węzeł** (ang. *Hub*) – Węzeł ma zapewnić władzom dostęp do bezpiecznej, scentralizowanej, wspólnej infrastruktury wymiany danych. Węzeł to warstwa sieciowa TREM. Węzeł ma dodatkowo służyć wymianie danych pomiędzy innymi systemami stworzonymi przez ESMA i władze właściwe.
- f. **System Danych Referencyjnych Instrumentów Finansowych** – dla potrzeb przetwarzania

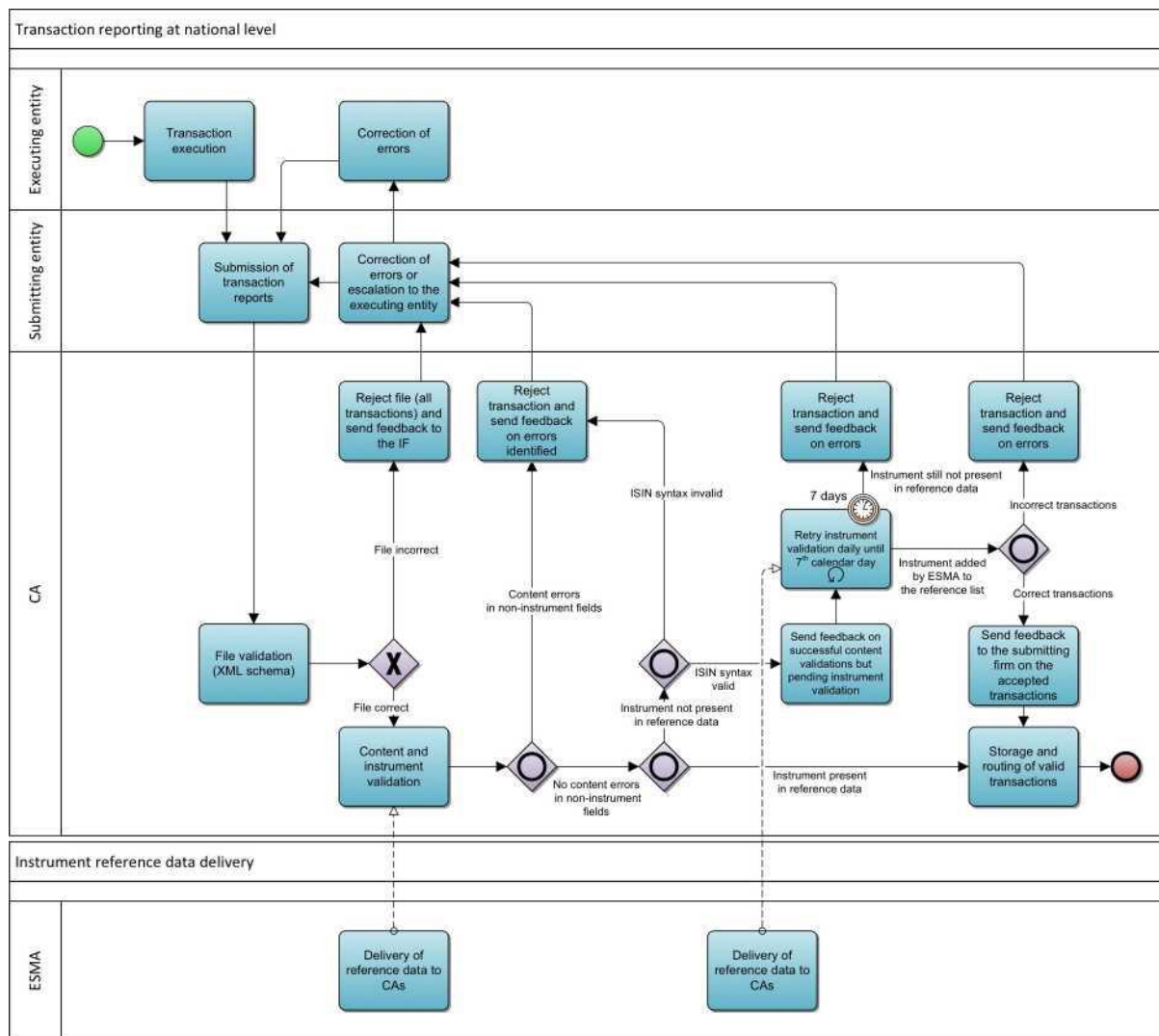
raportów o transakcjach (walidacja i przekazywanie), każdy organ krajowy musi dysponować nazwą odpowiedniej władzy właściwej odpowiedzialnej za wszystkie instrumenty, dla których wymagane są raporty o transakcjach, a także wspólnymi danymi referencyjnymi podlegającymi wymianie. Dane referencyjne o instrumentach będą publikowane przez ESMA.

1.3 Zakres niniejszego dokumentu

9. W niniejszym dokumencie opisano elementy interfejsu, który ma zostać wdrożony pomiędzy władzami właściwymi a podmiotami zgłaszającymi w ich państwach członkowskich w tym samym trybie przez wszystkie władze właściwe. Obejmuje to w szczególności:
 - a. Ogólny proces raportowania danych o transakcjach;
 - b. Wspólny format techniczny raportowania danych;
 - c. Wspólny zbiór mechanizmów kontroli jakości danych stosowanych w przypadku każdego raportu o transakcji.
10. Wszystkie uzgodnienia operacyjne i techniczne nieuwzględnione w niniejszym rozdziale zostaną określone i wdrożone przez władze właściwe wedle własnego uznania.
11. W szczególności władze właściwe określą i opracują następujące aspekty procesu:
 - a. Aplikacje/platformy stosowane w celu przyjmowania danych od podmiotów zgłaszających;
 - b. Konwencje pakowania i określania nazw plików przekazywanych do władz właściwych (tylko treść plików powinna podlegać harmonizacji i uzgodnieniu ze specyfikacjami normy ISO 20022);
 - c. Uzgodnienia w zakresie bezpieczeństwa danych (np. szyfrowanie plików czy kanały raportowania);
 - d. Ograniczenia w zakresie wielkości pliku / liczby rekordów w pliku.

2 Ogólny proces

12. Na poniższym wykresie przedstawiono proces raportowania transakcji na szczeblu krajowym:



Legenda:

Transaction reporting at national level – Raportowanie transakcji na szczeblu krajowym

Executing entity – Podmiot wykonujący transakcję

Transaction execution – Wykonanie transakcji

Correction of errors – Korekta błędów

Submitting entity – Podmiot zgłaszający

Submission of transaction reports – Zgłoszenie raportów o transakcjach

Correction of errors or escalation to the executing entity – Korekta błędów lub eskalacja do podmiotu wykonującego transakcję

CA – Władza właściwa

Reject files (all transactions) and send feedback to the IF – Odrzucenie pliku (wszystkich transakcji) i przesłanie informacji zwrotnej do interfejsu

Reject transactions and send feedback on errors identified – Odrzucenie transakcji i przesłanie informacji zwrotnej o stwierdzonych błędach

Reject transactions and send feedback on errors – Odrzucenie transakcji i przesłanie informacji zwrotnej o błędach

File incorrect – Nieprawidłowy plik

File correct – Prawidłowy plik

ISIN syntax invalid – Nieważna składnia kodu ISIN

Instrument still not present in reference data – Instrument nadal nie figuruje w danych referencyjnych

7 days – 7 dni

Incorrect transactions – Błędne transakcje

Correct transactions – Prawidłowe transakcje

Retry instrument validation daily until 7th calendar day – Ponowna walidacja instrumentu każdego dnia aż do 7. dnia kalendarzowego

Instrument added by ESMA to the reference list – ESMA dodała instrument do listy referencyjnej

File validation (XML schema) – Walidacja pliku (schema XML)

Content and instrument validation – Walidacja merytoryczna i walidacja instrumentu
 Content errors in non-instrument fields – Błędy merytoryczne w polach niezwiązanych z instrumentem
 ISIN syntax valid – Ważna składnia kodu ISIN
 Instrument not present in reference data – Instrument nie figuruje w danych referencyjnych
 No content errors in non-instrument fields – Brak błędów merytorycznych w polach niezwiązanych z instrumentem
 Instrument present in reference data – Instrument figuruje w danych referencyjnych
 Send feedback on successful content validations but pending instrument validation – Przesłanie informacji zwrotnej o pozytywnej walidacji merytorycznej, ale w oczekiwaniu na walidację instrumentu
 Send feedback to the submitting firm on the accepted transactions – Przesłanie do firmy zgłaszającej informacji zwrotnej o przyjętych transakcjach
 Storage and routing of valid transactions – Przechowywanie i przekazywanie ważnych transakcji
 Instrument reference data delivery – Przekazanie danych referencyjnych instrumentu
 ESMA – Europejski Organ Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych
 Delivery of reference data to CAs – Przekazanie danych referencyjnych do władz właściwych

13. W poniższej tabeli przedstawiono zestawienie terminów najważniejszych zdarzeń w ramach tego procesu:

Notacja	Zadanie	Termin
T	Wykonanie transakcji	
R	Zgłoszenie raportu o transakcji przez podmiot zgłaszający	T+1 dzień roboczy
	Przekazanie informacji zwrotnej do podmiotów zgłaszających	R+1 dzień kalendarzowy
		Maksymalnie R+7 w przypadku gdy instrument nie figuruje w danych referencyjnych

14. Raporty o transakcjach przekazywane są do władz właściwych przez:

- Firmy inwestycyjne zawierające transakcje, których przedmiotem są instrumenty finansowe;
- Zatwierdzone mechanizmy sprawozdawcze (ARM) działające w imieniu firm inwestycyjnych;
- Operatorów systemów obrotu, za pośrednictwem których zrealizowano transakcję.

15. Transakcje zawarte dnia T są zgłaszane nie później niż na koniec kolejnego dnia roboczego, czyli T+1.

16. W gestii każdej władzy właściwej pozostaje kwestia określenia szczegółowych procedur technicznych i harmonogramów przekazywania raportów.

17. Raporty przychodzące podlegają obowiązkowej walidacji:

- Walidacja pliku (formalna)** – sprawdzenie zgodności pliku ze schemą XML (składnia całego pliku oraz poszczególnych raportów o transakcjach). W przypadku niezgodności, cały plik (wszystkie transakcje zawarte w pliku) zostanie odrzucony.
- Walidacja treści (merytoryczna)** – zbiór zasad walidacji realizowanej w przypadku każdego raportu o transakcji celem sprawdzenia zawartości poszczególnych pól. Nieprawidłowe raporty o transakcjach podlegają odrzuceniu, zaś prawidłowe transakcje przekazywane są do dalszego przetwarzania. Takie zasady walidacji obejmują walidacje w zależności od danych referencyjnych instrumentu.

18. Każda władza właściwa powinna stosować walidację plików zgodnie z punktem 3.1. Takie zasady walidacji umożliwiają sprawdzenie poprawności składni pliku XML. W przypadku błędu w pliku, cały plik (wszystkie raporty o transakcjach zawarte w pliku) musi zostać odrzucony.

19. Po pozytywnej walidacji pliku, dla każdego raportu o transakcji zawartego w pliku należy zastosować zasady walidacji treści. Ze względu na wzajemne zależności pomiędzy tymi zasadami, należy je stosować w określonej kolejności. Celem jest zastosowanie wszystkich zasad walidacji dla każdego raportu o transakcji. Jednakże z uwagi na błędy stwierdzone przy stosowaniu niektórych zasad, może nie być możliwości zastosowania kolejnych zasad (np. w przypadku gdy podany kod CFI jest niewłaściwy,

zasady walidacji opierające się na kodzie CFI nie powinny być stosowane, gdyż nie ma możliwości, by jednoznacznie stwierdzić, czy walidacja oparta o kod CFI dała wynik pozytywny, czy nie, skoro sam kod CFI był błędny). W takich przypadkach walidację należy wstrzymać po zastosowaniu wszystkich zasad, które można zastosować do danego raportu o transakcji, a sam raport o transakcji należy odrzucić.

20. Zasady dotyczące treści obejmują w szczególności walidację sprawdzającą, czy instrument, którego dotyczy transakcja, bądź też instrument bazowy (w przypadku transakcji w obrocie niezorganizowanym lub transakcji zawartych na zorganizowanych platformach obrotu poza EOG) figuruje w danych referencyjnych, jeżeli zgłoszony kod ISIN jest poprawny pod względem składni / liczby kontrolnej. Można przy tym uwzględnić następujące przypadki:
- a. W przypadku gdy raport o transakcji jest poprawny (wszystkie zasady merytoryczne, w tym walidacja instrumentu, zostały spełnione), wówczas raport o transakcji zostanie przyjęty;
 - b. W przypadku braku błędów merytorycznych związanych z polami innymi niż instrument / instrument bazowy, przy czym błędna jest liczba kontrolna w podanym kodzie ISIN, transakcja powinna zostać odrzucona;
 - c. W przypadku braku błędów merytorycznych związanych z polami innymi niż instrument / instrument bazowy, przy czym w danych referencyjnych nie figuruje zgłaszany instrument / instrument bazowy, zaś składnia / liczba kontrolna w podanym kodzie ISIN jest prawidłowa, należy podjąć następujące działania:
 - i. władza właściwa zobowiązana jest poinformować podmiot zgłaszający, że transakcja oczekuje na walidację instrumentu / instrumentu bazowego;
 - ii. władza właściwa zobowiązana jest przeprowadzić walidację instrumentu / instrumentu bazowego każdego dnia aż do 7. dnia kalendarzowego po otrzymaniu raportu od podmiotu zgłaszającego;
 - iii. w przypadku gdy dane referencyjne instrumentu / instrumentu bazowego staną się dostępne w danych referencyjnych nie później niż do upływu 7. dnia kalendarzowego, przy czym walidacja instrumentu nie wykazuje błędów merytorycznych, transakcja powinna zostać przyjęta;
 - iv. w przypadku gdy dane referencyjne instrumentu / instrumentu bazowego staną się dostępne w danych referencyjnych nie później niż do upływu 7. dnia kalendarzowego, przy czym walidacja instrumentu wykazuje jeden lub więcej błędów merytorycznych, transakcja powinna zostać odrzucona;
 - v. w przypadku gdy instrument / instrument bazowy nadal nie figuruje w danych referencyjnych po 7 dniach kalendarzowych, władza właściwa powinna odrzucić raport o transakcji i przesłać odpowiednią wiadomość do podmiotu zgłaszającego;
 - d. W przypadku braku błędów merytorycznych związanych z polami innymi niż instrument / instrument bazowy, przy czym zgłaszany instrument / instrument bazowy nie figuruje w danych referencyjnych, zaś liczba kontrolna w podanym kodzie ISIN jest błędna, transakcję należy bezzwłocznie odrzucić;
 - e. W przypadku błędów merytorycznych związanych z polami innymi niż instrument / instrument bazowy, transakcję należy bezzwłocznie odrzucić, tj. nie czekając kolejnych 7 dni. Należy przekazać informację zwrotną o wszystkich stwierdzonych błędach.
21. W walidacji instrumentu opisanej w powyższym punkcie należy również stosować następujące zasady:
- a. W przypadku zawarcia transakcji w systemie obrotu w EOG lub za pośrednictwem podmiotu systematycznie internalizującego transakcje lub w trybie XOFF, należy dokonać walidacji instrumentu w polu 41, przy czym powinien on figurować w danych referencyjnych;
 - b. W przypadku zawarcia transakcji na zorganizowanej platformie obrotu poza EOG, należy dokonać walidacji instrumentu w polu 41 i polu 47, przy czym jeden z nich powinien figurować w danych referencyjnych (pole 41 podlega walidacji w pierwszej kolejności, a jeżeli instrument figuruje w danych referencyjnych, pole 47 pomija się);
 - c. W przypadku zawarcia transakcji w obrocie niezorganizowanym (pole systemu obrotu wypełnione wartością XXXX), należy dokonać walidacji instrumentu w polu 47, przy czym powinien on figurować w danych referencyjnych;
 - d. W przypadku zawarcia transakcji na zorganizowanej platformie obrotu poza EOG lub w obrocie

niezorganizowanym (pole systemu obrotu wypełnione wartością XXXX), jeżeli instrumentem bazowym jest indeks, nie dokonuje się walidacji instrumentu (tj. kodu ISIN indeksu) w oparciu o dane referencyjne instrumentu.

22. W przypadku gdy raport o transakcji nie spełnia jednej lub więcej zasad walidacji, taki raport powinien zostać odrzucony. Prawidłowe raporty należy przyjąć. Możliwa jest również sytuacja, w której niektóre rekordy z transakcjami zawarte w jednym pliku zostaną przyjęte, a inne odrzucone.
23. Zasad walidacji merytorycznej nie można wdrożyć w scheme XML. W związku z tym powinny one zostać wdrożone bezpośrednio w aplikacjach stosowanych przez władze właściwe.
24. Do walidacji transakcji zwartych pomiędzy godz. 00:00 a 23:59:59 czasu UTC w dniu T, władze właściwe stosują dane referencyjne na dzień T z wyjątkiem przypadku, w którym transakcja lub instrument zostanie przekazany z opóźnieniem (zob. również pkt 25). Dane referencyjne instrumentu na dzień T przekazywane są z systemu FIRDS nie wcześniej niż w dniu T+1 do godz. 08:00 czasu CET.
25. W celu rozwiązania problemów związanych z opóźnionym raportowaniem transakcji lub danych referencyjnych, w przypadku transakcji zwalidowanych lub przekazanych później niż w dniu T+1, władze właściwe zobowiązane są stosować ostatnie dane referencyjne dostępne w dniu walidacji / przekazania, przy czym w oparciu o takie dane referencyjne powinny sprawdzać, czy zgodnie z zastosowaną wersją danych referencyjnych dany rekord referencyjny (instrument, kod MIC, kod waluty itp.) był ważny na dzień T.
26. Pliki zwrotne należy generować i przekazywać podmiotom zgłaszającym nie później niż jeden dzień po zgłoszeniu raportu (tj. R+1, gdzie R to dzień raportowania). Jednakże mogą wystąpić opóźnienia w informacji zwrotnej dla niektórych transakcji z różnych powodów, np. niepełne dane referencyjne dla instrumentu zastosowane w walidacji.
27. Pliki zwrotne zawierają potwierdzenie prawidłowego złożenia raportów o transakcjach oraz powiadomienie o błędach w przypadku, gdy złożone raporty o transakcjach bądź całe pliki są nieprawidłowe. W informacji zwrotnej podaje się wszystkie stwierdzone błędy, nawet jeżeli dany raport o transakcji zawiera więcej niż jeden błąd.
28. W odniesieniu do statusu transakcji oczekującej, informacja zwrotna o transakcji oczekującej przekazywana jest wyłącznie jednorazowo pierwszego dnia, kiedy walidacja instrumentu okaże się nieudana. W przypadku gdy dana transakcja zachowuje status transakcji oczekującej w kolejnych dniach, nie powinna ona figurować w treści pliku. Taką transakcję należy ponownie wykazać w pliku zwrotnym dopiero wówczas, gdy jej status ulegnie zmianie (przyjęta lub odrzucona), tak by powiadomić podmiot zgłaszający o zmianie statusu.
29. Prawidłowe raporty o transakcjach po pełnej walidacji mogą zostać przesłane przez władzę właściwą, która je otrzymała od podmiotów zgłaszających, do innych władz właściwych na terytorium EOG zgodnie z wymogami art. 26 ust. 1 MiFIR i uzgodnieniami zawartymi pomiędzy władzami właściwymi.

3 Obsługa błędów

3.1 Informacje ogólne

30. W trakcie raportowania transakcja przechodzi przez systemy podmiotu wykonującego transakcję / zgłaszającego transakcję oraz władzy właściwej. W każdym przypadku, gdy transakcja przechodzi przez system, możliwe jest wystąpienie błędu, a w przypadku jego wykrycia należy o tym poinformować cały łańcuch uczestników i dokonać korekt.
31. Zgodność raportów o transakcjach z określonymi mechanizmami kontroli jakości danych / zasadami walidacji potwierdza się, stosując pliki zwrotne.
32. W przypadku każdego pliku otrzymanego od podmiotu zgłaszającego, władza właściwa przesyła jeden lub więcej plików zwrotnych. Taki plik zawiera informację o wynikach walidacji pliku i transakcji.
33. W przypadku przesłania pliku zwrotnego przez władzę właściwą do podmiotu zgłaszającego można odnotować dwa przypadki:
 - a. Przesłany plik jest prawidłowy (nie zawiera błędów)
 - i. Wówczas dokonuje się wymiany pliku zwrotnego potwierdzającego otrzymanie pliku i brak błędów.
 - b. Przesłany plik zawiera błędy:

- i. Dokonuje się wymiany pliku zwrotnego potwierdzającego otrzymanie pliku i stwierdzenie błędów.
 - ii. Podmiot zgłaszający powinien przesłać korektę błędów wskazanych w pliku zwrotnym.
34. W przypadku gdy podmiot zgłaszający nie otrzyma informacji zwrotnej do wcześniej zgłoszonych transakcji, powinien kontynuować raportowanie. Brak plików zwrotnych nie stanowi przesłanki zaprzestania raportowania.
35. Mogą wystąpić błędy następującego typu:
 - a. **Błąd pliku (formalny):** organ otrzymujący stwierdził błędy uniemożliwiające mu odczytanie otrzymanych plików np. błędny format XML;
 - b. **Błąd treści (merytoryczny):** błędy dotyczące rekordów transakcji, np. przyszła data transakcji, duplikat rekordu lub nieprawidłowy kod ISIN itp.
36. Z punktu widzenia władzy właściwej:
 - a. W przypadku stwierdzenia błędów formalnych, władza właściwa generuje plik zwrotny i nie musi wprowadzać żadnych rekordów z pliku (cały plik jest odrzucony);
 - b. W przypadku stwierdzenia błędów merytorycznych, rekordy zawierające błędy nie uczestniczą w zwykłej analizie/przetwarzaniu danych, np. nie są uwzględniane w prowadzeniu czynności wyjaśniających w sprawie nadużyć na rynku ani nie są przekazywane do innych krajowych władz właściwych.
37. Obowiązkiem podmiotu zgłaszającego jest zapewnienie, by wszystkie pliki zwrotne zostały przeanalizowane, a wszystkie raporty skorygowane:
 - a. W przypadku otrzymania informacji zwrotnej zawierającej błędy formalne, cały plik należy skorygować i ponownie przesłać;
 - b. W przypadku otrzymania informacji zwrotnej zawierającej błędy merytoryczne, należy skorygować wyłącznie błędne raporty o transakcjach i zamieścić je w nowym pliku przesyłanym do władzy właściwej (nowy plik może zawierać nowe raporty o transakcjach oraz korekty wcześniej odrzuconych transakcji);
 - c. W przypadku otrzymania informacji zwrotnej zawierającej status transakcji „RECEIVED” lub „PENDING”, podmiot zgłaszający nie jest zobowiązany do podjęcia żadnych działań związanych z taką transakcją.
38. W przypadku odrzuconych plików/raportów, nie należy stosować procesu anulowania w celu przesłania poprawionych plików/raportów, ponieważ władza właściwa nie zamieściła błędnych plików/raportów. Podmiot zgłaszający powinien przesłać poprawiony plik/raport tak, jakby to był zwykły plik/raport. W przypadku konieczności korekty przyjętej transakcji, podmiot zgłaszający powinien najpierw przesłać anulację, a następnie poprawiony nowy raport o transakcji.
39. W przypadku gdy raport o transakcji zostanie przyjęty przez władze właściwą, która otrzymała go od podmiotu zgłaszającego, przy czym po przekazaniu transakcji inna władza właściwa stwierdzi błędy, takie przypadki powinny podlegać ręcznej obsłudze przez przesyłającą władzę właściwą (tj. przesyłająca władza właściwa powinna podjąć wszystkie odpowiednie kroki w celu wykrycia powodów wystąpienia błędu i go poprawić).

3.2 Błędy formalne

40. W niniejszym rozdziale omówiono błędy dotyczące pliku oraz inne typy błędów, wskutek których plik jest nieczytelny lub niewiarygodny (zob. poniższe wyjaśnienia). Taki mechanizm kontrolny obsługuje władza właściwa, która również generuje odpowiedni plik zwrotny i przesyła go do podmiotu zgłaszającego. Ponadto po wykryciu błędu, nawet jeśli plik jest czytelny, cały plik zostaje odrzucony, a władza właściwa nie przetwarza rekordów.
41. Takie błędy dotyczą wyłącznie walidacji schemy XML. Schema XML dla raportów o transakcjach obejmować będzie szereg kontroli składni, w związku z czym dla potrzeb zachowania jakości danych ważne jest, by władze właściwe kontrolowały stosowanie odpowiedniej schemy przez podmioty zgłaszające.

Kontrola	Nr błędu	Komunikat o błędzie	Działanie naprawcze
Nieważny Identyfikator Komunikatu wg ISO 20022 w BAH (*.xsd).	FIL-104	Identyfikator Komunikatu wg ISO 20022 w BAH musi odnosić się do ostatniej zatwierdzonej schemy.	Korekta Identyfikatora Komunikatu wg ostatniej zatwierdzonej schemy.
Sprawdzenie, czy otrzymany plik jest zgodny z odpowiednią schemą XML.	FIL-105	Struktura pliku niezgodna ze schemą XML : [wynik walidacji XML]	Sprawdzenie wyniku walidacji, który powinien być zgodny z formatami określonymi w niniejszym dokumencie, zob. rozdział dot. XML, oraz ponowne przesłanie pliku.

42. Ostatni mechanizm kontrolny (FIL-105) wymaga szczególnej uwagi. W celu jego przeprowadzenia, władze właściwe będą stosować walidację XML sprawdzającą otrzymany plik w oparciu o przekazaną przez ESMA schemę XML. Walidacja XML generuje listę błędów lub komunikat 'OK'. W przypadku komunikatu 'OK', ostatnia kontrola jest ważna. W przeciwnym przypadku, władza właściwa powinna wypełnić komunikat o błędach w walidacji XML w zwrotnym komunikacie o błędach zamiast [\[wyniku walidacji XML\]](#).
43. Ta ostatnia kontrola jest bardzo ważna, gdyż sprawdza całość struktury XML i format wszystkich pól. W przypadku gdy jedno z pól ma nieprawidłowy format, cały plik zostanie odrzucony. Jest to bardzo rygorystyczna walidacja. W celu unikania problemów zaleca się, by podmioty zgłaszające posługiwały się schemami XML generując swoje pliki i je walidując przed ich przekazaniem do władz właściwych.
44. W konsekwencji stwierdzonych błędów, plik jest niewiarygodny. **Władza właściwa, która stwierdziła takie błędy, nie powinna zamieszczać takiego pliku.** Powinna natomiast przesłać komunikat zwrotny zawierający szczegółowe informacje o błędach (zob. powyżej) i czekać na kolejny plik. Podmiot zgłaszający musi przetworzyć plik zwrotny dla transakcji, skorygować problem i przesłać prawidłowy plik, nie korzystając z procesu anulowania.
45. W przypadku błędów formalnych, władza właściwa nie powinna podejmować walidacji merytorycznej, o której mowa w punkcie 3.3, tylko poczekać na złożenie prawidłowego pliku.
46. W odpowiednich przypadkach władze właściwe mogą wprowadzić dodatkowe zasady walidacji formalnej specyficzne dla procesów raportowania danych wdrożonych w swoich krajach. Takie dodatkowe zasady powinny ograniczać się do kontroli technicznej procesu raportowania (np. nazwa pliku, szyfrowanie itp.) i nie powinny wprowadzać walidacji merytorycznej raportów o transakcjach. W przypadku gdy władza właściwa wprowadzi takie zasady, należy stosować następującą konwencję kodów błędów:

AAX-NNN

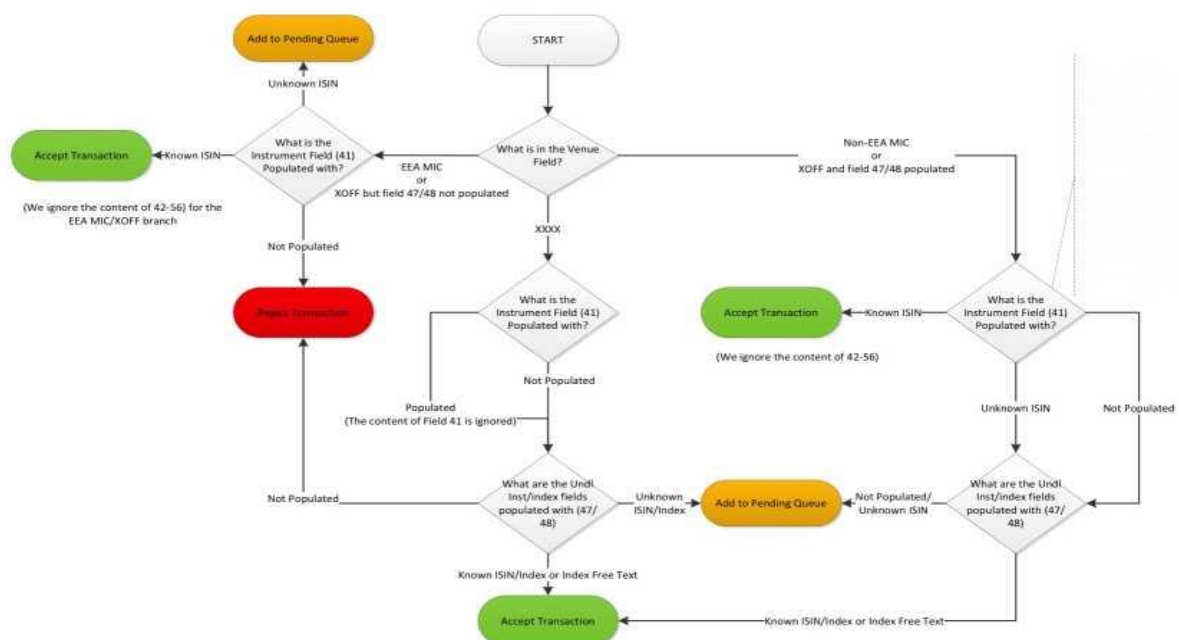
gdzie AA to kod kraju władzy właściwej, a NNN to kolejny numer zasady (np. kody zasad wprowadzonych dodatkowo przez władze francuskie byłyby następujące: FRX-001, FRX-002, FRX-003, ...).

3.3 Błędy merytoryczne

47. Już po przeprowadzeniu walidacji plików możliwe jest nadal wykrycie błędów, gdyż nie wszystkie zasady dotyczące jakości danych można wdrożyć w schemie XML. W takim przypadku wszystkie władze właściwe będą walidować wszystkie otrzymane raporty o transakcjach w swoich aplikacjach, stosując dodatkowe zasady walidacji merytorycznej.
48. Listę zasad walidacji merytorycznej, które powinny wdrożyć wszystkie władze właściwe, podano w Załączniku nr 1.
49. Każda transakcja zawarta w pliku powinna zostać sprawdzona zgodnie z odpowiednimi zasadami walidacji. W przypadku gdy dany raport nie jest zgodny z jedną lub większą liczbą zasad, taki raport zostanie odrzucony.
50. Zasady walidacji dotyczące danych referencyjnych instrumentu należy traktować jako przypadek

szczególony.

51. Możliwa jest sytuacja, w której instrument będący przedmiotem danej transakcji lub instrument bazowy (w przypadku transakcji, których przedmiotem są instrumenty niedopuszczone do obrotu, jeżeli instrument bazowy został dopuszczony do obrotu bądź stanowi indeks/koszyk instrumentów dopuszczonych do obrotu) nie figuruje w danych referencyjnych przekazanych przez ESMA władzom właściwym (np. z powodu opóźnienia w przekazaniu danych referencyjnych przez system obrotu).
52. W takim przypadku władza właściwa powinna przeprowadzić walidację pliku oraz pozostałe (niezwiązane z danymi referencyjnymi instrumentu) zasady walidacji merytorycznej, a jeżeli transakcja jest prawidłowa, władza właściwa powinna powiadomić podmiot zgłaszający o pozytywnej walidacji składni (ale jeszcze nie o przyjęciu raportu). W przypadku stwierdzenia na tym etapie błędów, transakcja powinna zostać odrzucona.
53. Władza właściwa powinna kontynuować walidację instrumentu aż do 7. dnia kalendarzowego po przyjęciu raportu od podmiotu zgłaszającego. W przypadku gdy dany instrument będzie w tym terminie figurować w danych referencyjnych, przy czym brak będzie błędów merytorycznych, taki rekord powinien zostać przyjęty. W przeciwnym przypadku po 7 dniach kalendarzowych władza właściwa powinna odrzucić raport o transakcji i przesłać podmiotowi zgłaszającemu odpowiedni komunikat.
54. Taki proces oczekiwania dotyczy wyłącznie danych referencyjnych instrumentu, a nie danych referencyjnych innego typu, które mogą być zastosowane w walidacji raportów o transakcjach. Na przykład jeżeli raport o transakcji zawiera w jednym z pól kod waluty, który nie figuruje na liście referencyjnej walut, taka transakcja powinna zostać bezzwłocznie odrzucona, bez czekania 7 kolejnych dni na dodanie danych referencyjnych waluty.
55. Kolejne zagadnienie związane z informacjami o instrumencie to wypełnianie pól 42-56. RTS przewidują, że te pola nie są wypełniane w przypadku transakcji zawartych w systemie obrotu lub z firmą inwestycyjną działającą jako podmiot systemowo integrujący transakcje, ani też w przypadku wypełnienia pola 41 kodem ISIN figurującym na przekazanej przez ESMA liście danych referencyjnych. Jednakże nawet w przypadku spełnienia powyższych warunków, jeżeli wypełniono wszystkie lub niektóre pola od 42 do 56, taki raport o transakcji nie zostanie odrzucony. Jeżeli taki raport ma być przekazany do innych władz właściwych, powinien on zostać przekazany wraz z wszystkimi informacjami zawartymi w oryginalnym raporcie, włączając w to pola 42-56.
56. Na poniższym wykresie podsumowano walidację instrumentu:



Legenda:
 Add to Pending Queue – Dodaj do kolejki oczekującej
 START – START
 Unknown ISIN – Nieznany kod ISIN
 Accept Transaction – Przyjmij transakcję
 Known ISIN – Znany kod ISIN

What is the Instrument Field (41) Populated with? – Jaka jest wartość w polu ‘Instrument’ (41)?
 EEA MIC or XOFF but fields 47/48 not populated – Kod MIC w EOG lub XOFF ale pól 47/48 nie wypełniono
 What is in the Venue Field? – Jaka jest wartość w polu ‘Miejsce realizacji transakcji’?
 Non-EEA MIC or XOFF and fields 47/48 populated – Kod MIC spoza EOG lub XOFF i pola 47/48 wypełniono
 (We ignore the content of 42-56) for the EEA MIC/XOFF branch – Pominąć zawartość pól 42-56 w przypadku kodu MIC z EOG lub XOFF oddziału
 Not Populated – Nie wypełniono
 Reject Transaction – Odrzuć transakcję
 Populated (The content of Field 41 is ignored) – Wypełniono (pominąć zawartość pola 41)
 (We ignore the content of 42-56) – Pominąć zawartość pól 42-56
 (The content of Field 41 is ignored) – Pominąć zawartość pola 41
 What are the Undl Inst/Index fields populated with (47/48) – Jaka jest wartość w polach ‘Instrument bazowy’/‘Indeks’ (47/48)?
 Unknown ISIN/Index – Nieznany kod ISIN/indeks
 Known ISIN/Index or Index Free Text – Znany kod ISIN/indeks lub wolny tekst dla indeksu
 In case of transaction with Non-EEA MIC field 41 shall be always validated first. If the ISIN in field 41 is included in reference data, then the transaction is accepted and the underlying instrument in field 47 is not validated. If the instrument in field 41 is unknown or not populated, then instrument reported in field 47 is validated. The same order applies for transactions that are in pending status. I.e. if the transaction is pending and the instrument in field 41 is added to reference data, the transaction can be accepted without validating field 47. – W przypadku transakcji z kodem MIC spoza EOG, zawsze w pierwszej kolejności należy dokonać walidacji pola 41. W przypadku gdy kod ISIN w polu 41 figuruje w danych referencyjnych, transakcja zostaje przyjęta i nie podejmuje się walidacji instrumentu bazowego w polu 47. W przypadku gdy instrument w polu 41 jest nieznan lub nie został podany, dokonuje się walidacji instrumentu podanego w polu 47. Ta sama kolejność dotyczy transakcji ze statusem transakcji oczekującej. Oznacza to, że jeżeli transakcja oczekuje, a instrument w polu 41 zostanie dodany do danych referencyjnych, transakcję można przyjmując bez walidacji pola 47.

57. Raporty o transakcjach nie będą zamieszczane w systemach władz właściwych aż do pozytywnego ukończenia pełnej walidacji (włączając w to walidację instrumentu). Oznacza to, że władze właściwe muszą przechowywać transakcje oczekujące na walidację instrumentu w tymczasowej kolejce.

58. Należy zauważyć, że w przypadku raportów z anulacją¹ zgłaszane są tylko pola 2, 4 i 6; w związku z tym, należy zastosować wyłącznie zasady merytoryczne związane z takimi polami.

3.3.1 Przykład – walidacja instrumentu

59. Na poniższym przykładzie przedstawiono, w jaki sposób powinna funkcjonować walidacja danych referencyjnych w systemie raportowania transakcji każdej władzy właściwej.

60. W celu uproszczenia przykładów i skupienia się na zasadach walidacji raportów o transakcjach w oparciu o dane referencyjne instrumentów ważne na dzień transakcji, przyjęto następujące założenia:

- Walidacja merytoryczna pola z instrumentem bazowym opiera się na tej samej logice, co dla pola z instrumentem;
- Wszystkie pozostałe zasady walidacji zostały pozytywnie spełnione dla wszystkich raportów o transakcjach;
- Typ instrumentu jest nieistotny – skupiamy się wyłącznie na dacie rozpoczęcia (data dopuszczenia) i zakończenia (termin wygaśnięcia) danego instrumentu;
- Wszystkie kody identyfikacyjne instrumentów są prawidłowo zbudowane i posiadają prawidłową liczbę kontrolną.

Dzień 1 (05/01/2016)

Dane referencyjne otrzymane przez ESMA dnia 04/01/16		
(Przekazane władzom krajowym o godz. 08:00 dnia 05/01/16)		
Nr instrumentu	Data dopuszczenia	Termin wygaśnięcia
Inst1	01/01/1980	
Inst2	01/01/2015	31/12/2030
Inst3	05/01/2016	
Inst4	04/01/2016	31/12/2030

Są to dane referencyjne przekazane przez ESMA. Każdy instrument posiada termin ważności (tj. okres od daty dopuszczenia do terminu wygaśnięcia).

¹ Szczegółowe informacje o procesie anulacji przedstawiono w części 4.

Plik z transakcjami 1			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn1-1	Inst1	31/12/2015	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 31/12/15
Txn1-2	Inst2	31/12/2015	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 31/12/15
Txn1-3	Inst3	04/01/2016	Odrzucony	instrument nieważny na dzień 04/01/16
Txn1-4	Inst4	05/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 05/01/16
Txn1-51	Inst5	04/01/2016	Oczekuje	instrument nieznan
Txn1-52	Inst5	31/12/2015	Oczekuje	instrument nieznan
Txn1-61	Inst6	04/01/2016	Oczekuje	instrument nieznan

Dzień 2 (06/01/2016)

Dane referencyjne otrzymane przez ESMA dnia 05/01/16		
(Przekazane władzom krajowym o godz. 08:00 dnia 06/01/16)		
Nr instrumentu	Data dopuszczenia	Termin wygaśnięcia
Inst1	01/01/1980	
Inst2	01/01/2015	31/12/2030
Inst3	04/01/2016*	
Inst4	04/01/2016	04/01/2016**
Inst5	04/01/2016***	

* System obrotu poprzednio podał błędną datę rozpoczęcia dla Inst3

** System obrotu dodał termin wygaśnięcia po pierwszym dniu obrotu

*** System obrotu dodał instrument z opóźnieniem z powodu błędu wewnętrznego.

Dzięki temu oczekująca transakcja, której przedmiotem był ten instrument, może być zwalidowana.

Tabela tymczasowa (nieprzetworzone transakcje z pliku 1)			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn1-51	Inst5	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/16
Txn1-52	Inst5	31/12/2015	Odrzucony	instrument nieważny na dzień 31/12/15
Txn1-61	Inst6	04/01/2016	Oczekuje	instrument nieznan*

Plik z transakcjami 2			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn2-1	Inst1	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/2016
Txn2-2	Inst2	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/2016
Txn2-3	Inst3	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/2016
Txn2-4	Inst4	05/01/2016	Odrzucony	Instrument nieważny na dzień 05/01/16
Txn2-5	Inst5	05/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 05/01/2016
Txn1-3**	Inst3	04/01/2016	Przyjęty	Instrument już ważny na dzień 04/01/2016

* Instrument wciąż ma status oczekujący. Władza krajowa nie powinna go uwzględniać w informacji zwrotnej przesłanej dnia 2, ponieważ transakcja była zawarta w informacji zwrotnej przesłanej dnia 1, a jej status się nie zmienił.

** Ponownie przesłana przez firmę zgłaszającą po stwierdzeniu, że wcześniejsze odrzucenie wynikało z błędów w danych referencyjnych.

Dzień 8 (12/01/2016)

Dane referencyjne otrzymane przez ESMA dnia 05/01/16		
(Przekazane władzom krajowym o godz. 08:00 dnia 12/01/16)		
Nr instrumentu	Data dopuszczenia	Termin wygaśnięcia
Inst1	01/01/1980	
Inst2	01/01/2015	31/12/2030
Inst3	04/01/2016	
Inst4	04/01/2016	04/01/2016
Inst5	04/01/2016	
Inst7	10/01/2016	

Tabela tymczasowa (nieprzetworzone transakcje z pliku 1)			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn1-61	Inst6	04/01/2016	Odrzucony	Instrument nie dodany do danych referencyjnych w ciągu 7 dni

Plik z transakcjami 8			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn8-1	Inst1	11/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 11/01/16
Txn8-2	Inst2	11/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 11/01/16
Txn8-3	Inst3	12/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 12/01/16
Txn8-5	Inst5	12/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 12/01/16

4 Proces anulacji

61. W przypadku gdy podmiot zgłaszający musi anulować wcześniej złożony raport o transakcji, powinien przesłać raport z anulacją zawierający następujące pola:
- Numer referencyjny transakcji (pole 2);
 - Kod identyfikacyjny podmiotu wykonującego transakcję (pole 4);
 - Kod identyfikacyjny podmiotu zgłaszającego transakcję (pole 6).
62. Pola 2 i 4 łącznie tworzą niepowtarzalny klucz identyfikujący raport o transakcji. Muszą być tożsame z oryginalnym raportem transakcji.
63. Anulację można zgłosić wyłącznie dla raportów o transakcjach, które zostały przyjęte lub oczekują na walidację instrumentu. W związku z tym nie można zgłaszać raportów z anulacją do raportów o transakcjach, które władza właściwa odrzuciła.
64. W przypadku gdy anulacja zostanie wysłana dla raportu o transakcji oczekującego na walidację instrumentu, walidacja takiego raportu zostaje przerwana bez czekania na dodanie takiego rekordu instrumentu do danych referencyjnych, a raport o transakcji uznaje się za anulowany.

4.1 Aktualizacja rekordu

65. W przypadku konieczności aktualizacji raportu o transakcji, podmiot zgłaszający powinien anulować oryginalny rekord i przesłać zaktualizowaną wersję raportu jako nowy raport o transakcji. W przypadku wysłania zmienionego raportu do transakcji, której wcześniej nie anulowano, taki raport zostanie odrzucony.
66. W przypadku korekty oryginalnego raportu o transakcji, w zmienionym raporcie należy zastosować ten sam numer referencyjny transakcji, co w oryginalnym raporcie podlegającym zmianie.

4.2 Rekordy anulacji w schemie XML

67. Pliki XML mogą zawierać rekordy dwóch typów:
- Nowe rekordy transakcji;
 - Rekordy anulacji.
68. Plik może zawierać nowe rekordy transakcji, rekordy anulacji, bądź jedno i drugie.
69. Nowy rekord transakcji zawiera raport o transakcji z firmy inwestycyjnej. Rekord anulacji zawiera anulację rekordu transakcji, który już został wysłany lub został zawarty w tym samym pliku przed rekordem anulacji. Oznacza to, że raporty o transakcjach powinny zostać zamieszczone w pliku w odpowiedniej kolejności i mają być przetwarzane w tej samej kolejności, w jakiej figurują w pliku.
70. Specyfikację schemy XML dla nowego rekordu i rekordu anulacji przedstawiono w Załączniku nr 2.
71. W poniższej tabeli przedstawiono przykłady scenariuszy anulacji:

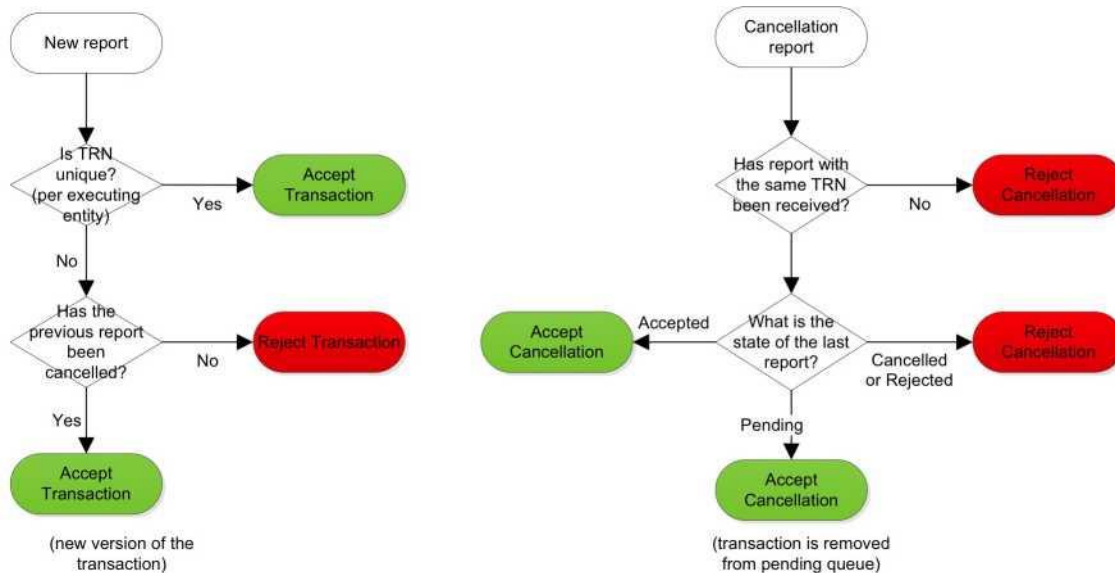
Scenariusz	Dzień	TRN	Typ raportu	Status informacji zwrotnej	Uwagi
1. Anulowanie przyjętej transakcji	T+1	Txn1-62	Nowy	ACPT	
	T+2	Txn1-62	Anulacja	ACPT	
2. Anulowanie odrzuconej transakcji	T+1	Txn1-62	Nowy	RJCT	
	T+2	Txn1-62	Anulacja	RJCT	Nową transakcję z tym samym numerem TRN odrzucono, w związku z czym anulację również należy odrzucić.

3. Anulowanie transakcji oczekującej	T+1	Txn1-62	Nowy	PNDG	Jeżeli dane referencyjne instrumentu nie są dostępne, transakcja może zachować status transakcji oczekującej przez 7 dni.
	T+2	Txn1-62	Anulacja	ACPT	Po otrzymaniu raportu z anulacją dla transakcji oczekującej, władza właściwa powinna przyjąć raport z anulacją (i przekazać odpowiednią informację zwrotną do podmiotu zgłaszającego) oraz usunąć transakcję z kolejki transakcji oczekujących.
4. Anulowanie transakcji otrzymanej	T	Txn1-62	Nowy	RCVD	Transakcję Txn1-62 otrzymano i zostanie ona przetworzona w dniu T+1, kiedy dostępne będą dane referencyjne.
	T	Txn1-62	Anulacja	RCVD	Anulację transakcji Txn1-62 otrzymano i zostanie ona przetworzona w dniu T+1 zgodnie z powyższymi scenariuszami (1, 2, 3).

4.3 Cykl życia raportów o transakcjach

72. Na poniższych wykresach przedstawiono podsumowanie procesu składania nowych raportów / anulacji oraz cykl życia transakcji.

Przetwarzanie nowego raportu / anulacji



Legenda:

New report – Nowy raport

Is TRN unique? (per executing entity) – Czy numer TRN jest niepowtarzalny? (dla podmiotu wykonującego transakcję)

Yes – Tak

Accept Transaction – Przyjąć transakcję

No – Nie

Has the previous report been cancelled? – Czy poprzedni raport anulowano?

Reject Transaction – Odrzucić transakcję

(new version of the transaction) – (nowa wersja transakcji)

Cancellation report – Raport z anulacją

Has report with the same TRN been received? – Czy otrzymano raport z tym samym numerem TRN?

Reject Cancellation – Odrzucić anulację

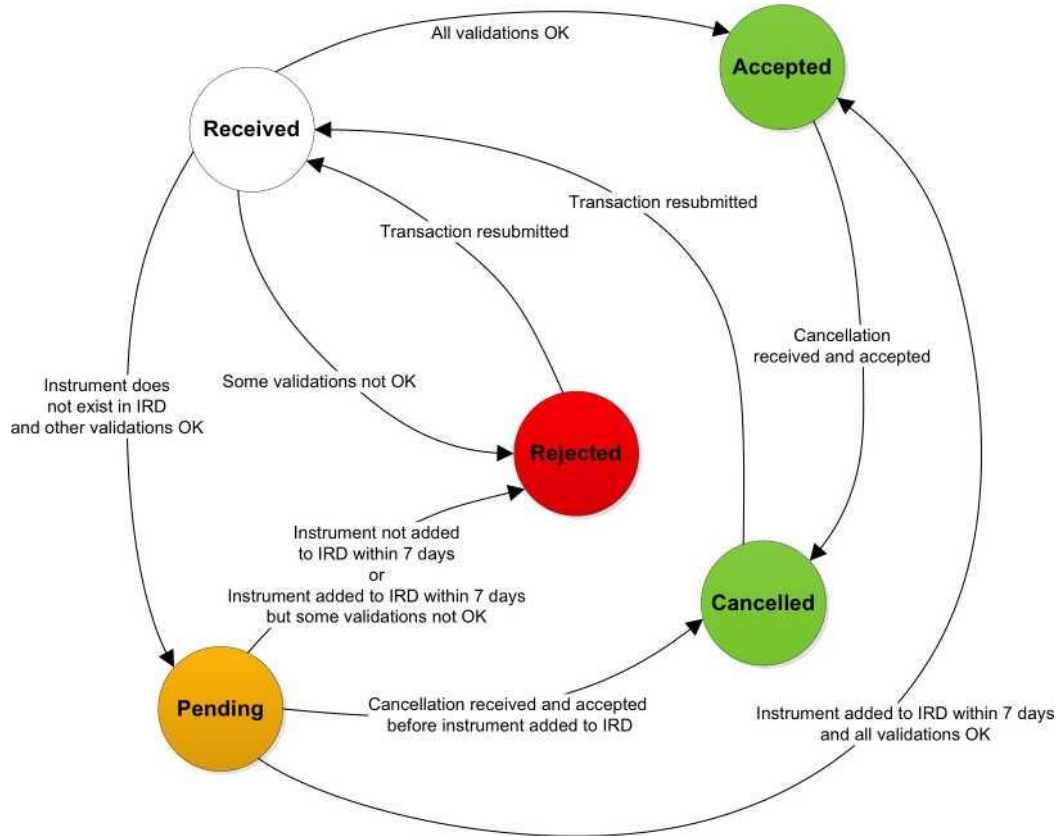
Accept Cancellation – Przyjąć anulację

Accepted – Przyjęty

What is the state of the last report? – Jaki jest stan poprzedniego raportu?

Cancelled or Rejected – Anulowany lub Odrzucony
(transaction is removed from pending queue) – (transakcję należy usunąć z kolejki oczekującej)

Cykl życia transakcji



Legenda:

Received – Otrzymana

All validations OK – Wszystkie walidacje OK

Accepted – Przyjęta

Transaction resubmitted – Ponowne zgłoszenie transakcji

Instrument does not exist in IRD and other validations OK – Instrument nie figuruje w danych referencyjnych instrumentu, a pozostałe walidacje OK

Some validations not OK – Niektóre walidacje nie OK

Rejected – Odrzucona

Cancellation received and accepted – Anulacja otrzymana i przyjęta

Instrument not added to IRD within 7 days or Instrument added to IRS within 7 days but some validations not OK – Instrument nie dodany do danych referencyjnych instrumentu w ciągu 7 dni lub Instrument dodany do danych referencyjnych instrumentu w ciągu 7 dni, ale niektóre walidacje nie OK

Cancelled – Anulowana

Pending – Oczekuje

Cancellation received and accepted before instrument added to IRS - Anulacja otrzymana i przyjęta przed dodaniem instrumentu do danych referencyjnych instrumentu

Instrument added to IRS within 7 days and all validations OK – Instrument dodany do danych referencyjnych instrumentu w ciągu 7 dni i wszystkie walidacje OK

5 Techniczne protokoły zbierania danych od podmiotów zgłaszających

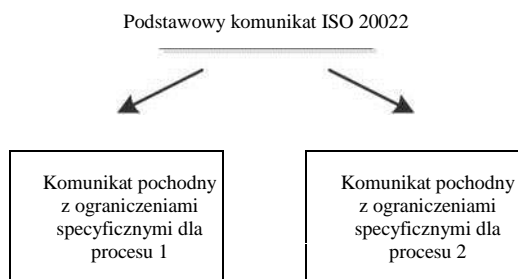
73. Władze właściwe powinny zapewnić odpowiedni poziom bezpieczeństwa interfejsu służącego do odbioru danych od podmiotów zgłaszających. W szczególności władze właściwe mogą zastosować następujące bezpieczne protokoły (jeden lub więcej) w celu otrzymywania raportów o transakcjach od podmiotów zgłaszających:
 - a. SFTP;
 - b. HTTPS.
74. Odpowiednie szczegółowe informacje techniczne dotyczące przekazywania danych przez podmioty zgłaszające zostaną określone przez poszczególne władze właściwe.

6 Komunikaty ISO 20022

75. W niniejszej części opisano zasady stosowania komunikatów ISO 20022.
76. Oprócz zasad opisanych w niniejszym rozdziale, szczegółowe specyfikacje techniczne komunikatu przedstawiono w Załączniku nr 2.

6.1 Informacje ogólne

77. Format wszystkich komunikatów stosowanych dla potrzeb zgłaszania transakcji zgodnie z MiFIR jest zgodny z metodologią normy ISO 20022. Dla potrzeb tego wymogu raportowania opracowano zbiór nowych komunikatów. Jednakże w niezbędnym zakresie ponownie wykorzystano elementy już istniejących komunikatów ISO 20022.
78. Stosuje się cztery rodzaje komunikatów:
- Komunikat o dacie transakcji;
 - Komunikat o statusie / komunikat zwrotny (stosowany w informacji zwrotnej z aplikacji i Węzła);
 - nagłówek Business Application Header;
 - nagłówek Business File Header.
79. W celu zagwarantowania najwyższego poziomu dostosowania komunikatów do szczegółowych potrzeb zgłaszania transakcji zgodnie z MiFIR oraz procesami wymiany transakcji, komunikaty XML zgodne z normą ISO 20022 poddano dalszemu dostosowaniu. Opracowano zbiór komunikatów bazujących na podstawowych komunikatach ISO 20022.



80. Dostosowanie dotyczyło w szczególności następujących aspektów komunikatów:
- Usunięcie elementów niestosowanych w danym procesie;
 - Ograniczenie częstotliwości występowania niektórych elementów, np. elementy opcjonalne w podstawowym komunikacie są obowiązkowe w poszczególnych procesach;
 - Ograniczenie listy dozwolonych kodów;
 - Ograniczenie dozwolonych znaków w polach tekstowych i wprowadzenie konkretnych wzorców;
 - Ograniczenie zbioru wartości dozwolonych w polach numerycznych.
81. Schemy pochodne posiadają tę samą ogólną strukturę, co schema podstawowa, przy czym mogą podlegać bardziej rygorystycznej walidacji. Instancja pliku XML utworzona z zastosowaniem schemy pochodnej jest zawsze zgodna ze schemą podstawową.
82. Na przykład element XML dotyczący powodu wymiany jest istotny tylko w procesie wymiany danych o transakcjach pomiędzy władzami właściwymi. Taki element jest opcjonalny w komunikacie

bazowym. W komunikatach pochodnych został on usunięty z komunikatu służącego podmiotom zgłaszającym do raportowania do władz właściwych, ale jest obowiązkowy w komunikacie stosowanym przez władze właściwe do wymiany raportów o transakcjach z innymi władzami właściwymi.

83. We wszystkich komunikatach zastosowano wersję 1.0 schemy XML.
84. We wszystkich komunikatach należy stosować zestaw znaków UTF-8. Może on odpowiadać szerokiej gamie znaków. Ponadto jest wstecznie zgodny z ASCII i zapewnia zwartą reprezentację (1 bajt / znak) dla większości znaków stosowanych w komunikatach zgodnie z MiFIR. Zestaw znaków stosowany w komunikacie należy wskazać w parametrze kodowania dokumentu XML.
85. Należy zauważyć, że znaki '&' i '<' nie stanowią dozwolonej wartości atrybutów XML. Komunikaty zawierające takie znaki zostaną odrzucone.
86. Schema pochodna zostanie opracowana za pośrednictwem platformy MyStandards udostępnionej przez SWIFT i zostanie opublikowana w wytycznych dla użytkownika na niniejszym portalu.

6.2 Komunikat o dacie transakcji

87. Komunikat o dacie transakcji umożliwia raportowanie daty transakcji zgodnie z postanowieniami RTS dotyczących obowiązków raportowania zgodnie z art. 26 MiFIR.
88. Należy podkreślić, że struktura komunikatu pozwala na raportowanie dwóch typów raportów o transakcjach:
 - a. Nowy raport (tag <New>) – stosuje się wszystkie pola zgodnie z RTS;
 - b. Raport z anulacją (tag <Cxl>) – stosuje się tylko wybrane pola (szczegółowe informacje o procesie anulacji podano w części 4).
89. Oprócz pól wskazanych w RTS, komunikat zawiera również atrybuty techniczne wymagane dla potrzeb wymiany danych o transakcjach pomiędzy władzami właściwymi.
90. ESMA wprowadziła szereg dodatkowych ograniczeń do podstawowego komunikatu ISO 20022. Ponieważ pomiędzy komunikatem stosowanym przez podmioty zgłaszające przy raportowaniu do władz właściwych a wymianą pomiędzy władzami właściwymi występują pewne różnice, dla potrzeb tych procesów opracowano dwa oddzielne komunikaty.
91. Schemy XML dla podstawowego komunikatu XML wg ISO 20022 i komunikatów objętych dodatkowymi obostrzeniami przedstawiono w Załączniku nr 2.

6.3 Komunikat o statusie / komunikat zwrotny

92. Komunikat o statusie zawiera dwa bloki informacji:
 - a. Nagłówek zawierający informacje związane ze statusem całego pliku (raportu);
 - b. Szczegółowe informacje zwrotne dotyczące każdej transakcji.
93. Podobnie jak wszystkie inne komunikaty ISO 20022, komunikat o statusie powinien zostać przesłany wraz z nagłówkiem Business Application Header. Złożony element „Powiązany komunikat” w nagłówku Business Application Header powinien zawierać odniesienie do oryginalnego komunikatu, z którym związany jest komunikat zwrotny.
94. W przypadku odrzucenia pliku lub rekordu, kod status powinien być uzupełniony konkretnym kodem błędu, wskazującym zastosowaną zasadę walidacji oraz charakter błędu. Kodom błędu powinien towarzyszyć odpowiedni komunikat o błędzie.
95. Błędy dotyczące poszczególnych transakcji powinny być wskazane w postaci konkatenacji kodu identyfikacyjnego podmiotu wykonującego transakcję (pole 4), a następnie numeru referencyjnego transakcji (pole 2) bez rozdzielenia ich dodatkowymi znakami.
96. W kolejnych dwóch częściach przedstawiono w tabelach szczegółowe zasady stosowania kodów statusu w przypadku plików i transakcji.

6.3.1 Status pliku

97. W poniższej tabeli przedstawiono listę stosowanych kodów statusu i kodów błędu:

Kod statusu	Nazwa	Definicja	Zastosowanie w raportach podmiotów zgłaszających
ACPT	Przyjęto	Raport został przyjęty.	Status stosowany w przypadku przyjęcia wszystkich transakcji w raporcie.
PART	Częściowo przyjęto	Raport został częściowo przyjęty. Niektóre transakcje przyjęto, a pozostałych nie przyjęto.	Status stosowany w przypadku przyjęcia niektórych transakcji zawartych w pliku oraz otrzymania, odrzucenia lub oczekiwania na walidację pozostałych. W takim przypadku status i kod błędu dla odrzuconej (lub oczekującej) transakcji powinien również być podany w złożonym elemencie RcrdSts.
PDNG	Oczekuje	Przetwarzanie raportu lub transakcji w toku.	Nie stosowany.
RCVD	Otrzymano	Raport otrzymano.	Nie stosowany.
RJCT	Odrzucono	Cały raport odrzucono.	Status stosowany w przypadku odrzucenia całego pliku z następującym kodem błędu: FIL-103, FIL-104 (oraz ewentualnie inne błędy formalne wdrożone na szczeblu krajowym) lub w przypadku odrzucenia wszystkich transakcji w pliku. W tym drugim przypadku, status odrzucenia i odpowiednie kody błędu należy podać dla każdej odrzuconej transakcji w złożonym elemencie RcrdSts.

RMDR	Monit	Przypomnienie o nieotrzymanym raporcie.	Nie stosowany.
INCF	Nieprawidłowa nazwa pliku	Plik zawierający raport ma nieprawidłową nazwę.	Opcjonalnie. Status można stosować razem z kodami błędów związanymi z konwencją nazw wdrożonymi na szczeblu krajowym.
CRPT	Plik uszkodzony	Plik zawierający raport jest uszkodzony.	Kod statusu stosowany w przypadku, gdy cały plik zostanie uznany za błędny i nie może zostać otwarty, wraz z kodami błędów związanymi z prawidłowością całego pliku wdrożonymi na szczeblu krajowym (np. plik nie może zostać otwarty i odszyfrowany).
WARN	Ostrzeżenie	Plik przyjęto z ostrzeżeniem.	Nie stosowany.

6.3.2 Status transakcji

98. W poniższej tabeli przedstawiono listę stosowanych kodów statusu i kodów błędów:

Kod statusu	Nazwa	Definicja	Zastosowanie w raportach podmiotów zgłaszających
ACPT	Przyjęto	Transakcja została przyjęta.	W trakcie pierwszej walidacji pliku kod statusu ACPT podaje się wyłącznie w statystyce komunikatu pliku ze statusem. Status można wskazać bezpośrednio w przypadku transakcji, która wcześniej miała status PDNG.
ACPD	Przyjęto po oczekiwaniu	Transakcja oczekująca w poprzednim raporcie została przyjęta.	Nie stosowany.

PDNG	Oczekuje	Transakcja oczekuje na przetwarzanie.	<p>Kod statusu stosowany w przypadku, gdy raport o transakcji nie może być zwalidowany z braku danych referencyjnych instrument.</p> <p>W złożonym elemencie RcrdSts należy podać kod błędu CON-411 (oczekiwanie na walidację instrumentu), CON-471 (oczekiwanie na walidację instrumentu bazowego).</p> <p>W przypadku zastosowania tego statusu, transakcja powinna zostać zgłoszona jako odrzucona lub przyjęta w jednym z kolejnych komunikatów zwrotnych wysłanym w ciągu nie więcej niż 7 dni.</p>
WARN	Ostrzeżenie	Transakcję przyjęto z ostrzeżeniem.	Nie stosowany.
RJCT	Odrzucono	Transakcję odrzucono.	Kod statusu stosowany w przypadku błędnego raportu o transakcji. Kody błędów wskazujące naruszone zasady walidacji należy wskazać w elemencie złożonym RcrdSts (kody CON-NNN z wyjątkiem CON-411 i CON-471).
RJPD	Odrzucono po oczekiwaniu	Transakcja oczekująca w poprzednim raporcie została odrzucona.	Nie stosowany.
RCVD	Przyjęto	Transakcja została przyjęta i oczekuje na walidację.	<p>Kod statusu stosowany w przypadku raportu o transakcji, którego nie można zwalidować, w szczególności w przypadku, gdy raport o transakcji został złożony w dniu T, a dane referencyjne na ten dzień nie są jeszcze dostępne (dane referencyjne na dzień T przekazuje się w dniu T+1).</p> <p>Kod statusu RCVD podaje się wyłącznie w statystyce komunikatu pliku ze statusem.</p>

99. Plik z informacją o statusie powinien również zawierać informacje statystyczne dotyczące:

- a. Łącznej liczby rekordów otrzymanych w oryginalnym pliku;
- b. Liczby rekordów dla każdego statusu po walidacji.

Takie informacje powinny być zawarte w elemencie Sttstcs i powinny być podane dla wszystkich plików, które przeszły walidację formalną. W przypadku odrzucenia całego pliku z powodu błędu formalnego, element Sttstcs nie powinien figurować w komunikacie z informacją o statusie.

6.3.3 Przykład nr 1

100. Na poniższych wykresach przedstawiono scenariusz opisany w przykładzie:

Dzień 1 (05/01/2016)

Dane referencyjne otrzymane przez ESMA dnia 04/01/16		
(Przekazane władzom krajowym o godz. 08:00 dnia 05/01/16)		
Nr instrumentu	Data dopuszczenia	Termin wygaśnięcia
Inst1	01/01/1980	
Inst2	01/01/2015	31/12/2030
Inst3	05/01/2016	
Inst4	04/01/2016	31/12/2030

Plik z transakcjami 1			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn1-1	Inst1	31/12/2015	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 31/12/15
Txn1-2	Inst2	31/12/2015	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 31/12/15
Txn1-3	Inst3	04/01/2016	Odrzucony	instrument nieważny na dzień 04/01/16
Txn1-4	Inst4	05/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 05/01/16
Txn1-51	Inst5	04/01/2016	Oczekuje	instrument niezany
Txn1-52	Inst5	31/12/2015	Oczekuje	instrument niezany
Txn1-61	Inst6	04/01/2016	Oczekuje	instrument niezany
Txn1-2	Inst2	31/12/2015	Odrzucony	Instrument ważny, ale inne transakcja z tym samym numerem referencyjnym została zgłoszona wcześniej (CON-020)

101. Komunikat z informacją o statusie wysłany dnia 1 jest następujący:

Numer referencyjny transakcji	Status transakcji	Kod błędu	Komunikat o błędzie
Txn1-3	RJCT	CON-412	Instrument nie figuruje w danych referencyjnych na datę transakcji
Txn1-51	PDNG	CON-411	Oczekiwanie na walidację instrumentu
Txn1-52	PDNG	CON-411	Oczekiwanie na walidację instrumentu

Txn1-61	PDNG	CON-411	Oczekiwanie na walidację instrumentu
Txn1-2	RJCT	CON-023	Już wysłano dla firmy raport o transakcji z tym samym numerem referencyjnym transakcji

102. Struktura XML komunikatu z informacją o statusie:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
```

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:2002:tech:xsd:auth.031.001.01"
```

```
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
```

```
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:2002:tech:xsd:auth.031.001.01 auth.031.001.01.xsd">
```

```
<FinInstrmRptgStsAdv>
```

```
<MsgStsAdv>
```

```
<MsgRptIdr>TrasnactionFile1</MsgRptIdr>
```

```
<MsgSts>
```

```
<RptSts>PART</RptSts>
```

```
<Sttstcs>
```

```
<TtlNbOfRcrds>8</TtlNbOfRcrds>
```

```
<NbOfRcrdsPerSts>
```

```
<DtldNbOfTxS>3</DtldNbOfTxS>
```

```
<DtldSts>PDNG</DtldSts>
```

```
</NbOfRcrdsPerSts>
```

```
<NbOfRcrdsPerSts>
```

```
<DtldNbOfTxS>2</DtldNbOfTxS>
```

```
<DtldSts>RJCT</DtldSts>
```

```
</NbOfRcrdsPerSts>
```

```
<NbOfRcrdsPerSts>
```

```
<DtldNbOfTxS>3</DtldNbOfTxS>
```

```
<DtldSts>ACPT</DtldSts>
```

```
</NbOfRcrdsPerSts>
```

```
</Sttstcs>
```

```
</MsgSts>
```

```
<RcrdSts>
```

```
<OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-3</OrgnlRcrdId>
```

```
<Sts>RJCT</Sts>
```

```
<VldtnRule>
```

```
<Id>CON-412</Id>
```

```
<Desc>Instrument Inst1 nie figuruje w danych referencyjnych na datę transakcji</Desc>
```

```
<Issr>Podmiot</Issr>
```

```
</VldtnRule>
```

```

</RcrdSts>
<RcrdSts>
  <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-51</OrgnlRcrdId>
  <Sts>PDNG</Sts>
  <VldtnRule>
    <Id>CON-411</Id>
    <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
  </VldtnRule>
</RcrdSts>
<RcrdSts>
  <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-52</OrgnlRcrdId>
  <Sts>PDNG</Sts>
  <VldtnRule>
    <Id>CON-411</Id>
    <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
  </VldtnRule>
</RcrdSts>
<RcrdSts>
  <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-61</OrgnlRcrdId>
  <Sts>PDNG</Sts>
  <VldtnRule>
    <Id>CON-411</Id>
    <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
  </VldtnRule>
</RcrdSts>
<RcrdSts>
  <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-2</OrgnlRcrdId>
  <Sts>RJCT</Sts>
  <VldtnRule>
    <Id>CON-023</Id>
    <Desc>Już wysłano dla firmy raport o transakcji z tym
samym numerem referencyjnym transakcji</Desc>
    <Issr>Podmiot</Issr>
  </VldtnRule>
</RcrdSts>
</MsgStsAdvc>
</FinInstrmRptgStsAdvc>
</Document>

```

103. Transakcji Txn1-1, Txn1-2 i Txn1-4 nie podaje się w komunikacie z informacją o statusie. W przypadku braku zgłoszenia błędu do danej transakcji, zakłada się, że transakcja została przyjęta.

104. Za dzień 2 stosuje się następujące raporty:

Dzień 2 (06/01/2016)

Dane referencyjne otrzymane przez ESMA dnia 05/01/16		
(Przekazane władzom krajowym o godz. 08:00 dnia 06/01/16)		
Nr instrumentu	Data dopuszczenia	Termin wygaśnięcia
Inst1	01/01/1980	
Inst2	01/01/2015	31/12/2030
Inst3	04/01/2016	
Inst4	04/01/2016	04/01/2016
Inst5	04/01/2016	

Tabela tymczasowa (nieprzetworzone transakcje z pliku 1)			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn1-51	Inst5	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/16
Txn1-52	Inst5	31/12/2015	Odrzucony	instrument nieważny na dzień 31/12/15
Txn1-61	Inst6	04/01/2016	Oczekuje	instrument nieznan

Plik z transakcjami 2			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn2-1	Inst1	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/2016
Txn2-2	Inst2	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/2016
Txn2-3	Inst3	04/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 04/01/2016
Txn2-4	Inst4	05/01/2016	Odrzucony	Instrument nieważny na dzień 05/01/16
Txn2-5	Inst5	05/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 05/01/2016
Txn1-3	Inst3	04/01/2016	Przyjęty	Instrument już ważny na dzień 04/01/2016

105. Komunikat z informacją o statusie wysłany dnia 2 jest następujący:

Numer referencyjny transakcji	Status transakcji	Kod błędu	Komunikat o błędzie
Txn1-51	ACPT		
Txn1-52	RJCT	CON-412	Instrument nie figuruje w danych referencyjnych na datę transakcji
Txn2-4	RJCT	CON-412	Instrument nie figuruje w danych referencyjnych na datę transakcji

106. Struktura XML komunikatu z informacją o statusie:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:2002:tech:xsd:auth.031.001.01"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:2002:tech:xsd:auth.031.001.01 auth.031.001.01.xsd">
  <FinInstrmRptgStsAdv>
    <MsgStsAdv>
      <MsgRptIdr>TransactionFile2</MsgRptIdr>
      <MsgSts>
        <RptSts>PART</RptSts>
        <Sttstcs>
          <TtlNbOfRcrds>6</TtlNbOfRcrds>
          <NbOfRcrdsPerSts>
            <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
            <DtldSts>RJCT</DtldSts>
          </NbOfRcrdsPerSts>
          <NbOfRcrdsPerSts>
            <DtldNbOfTxs>5</DtldNbOfTxs>
            <DtldSts>ACPT</DtldSts>
          </NbOfRcrdsPerSts>
        </Sttstcs>
      </MsgSts>
      <RcrdSts>
        <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn2-4</OrgnlRcrdId>
        <Sts>RJCT</Sts>
        <VldtnRule>
          <Id>CON-412</Id>
          <Desc>Instrument Inst4 nie figuruje w danych referencyjnych na datę
transakcji</Desc>
        <VldtnRule>
          </VldtnRule>
        </RcrdSts>
      </MsgStsAdv>
    <MsgStsAdv>
      <MsgRptIdr>TransactionFile1</MsgRptIdr>
      <MsgSts>
        <RptSts>PART</RptSts>
        <Sttstcs>
          <TtlNbOfRcrds>3</TtlNbOfRcrds>
          <NbOfRcrdsPerSts>
            <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
```

```

        <DtldSts>ACPT</DtldSts>
    </NbOfRcrdsPerSts>
    <NbOfRcrdsPerSts>
        <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
        <DtldSts>RJCT</DtldSts>
    </NbOfRcrdsPerSts>
    <NbOfRcrdsPerSts>
        <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
        <DtldSts>PDNG</DtldSts>
    </NbOfRcrdsPerSts>
</Sttstcs>
</MsgSts>
<RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-51</OrgnlRcrdId>
    <Sts>ACPT</Sts>
</RcrdSts>
<RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-52</OrgnlRcrdId>
    <Sts>RJCT</Sts>
<VldtnRule>
    <Id>C0N-412</Id>
    <Desc>Instrument Inst5 nie figuruje w danych referencyjnych na
datę transakcji</Desc>
</VldtnRule>
</RcrdSts>
</MsgStsAdv<
</FinInstrmRptgStsAdv>
</Document>

```

107. Transakcja Txn1-51 została przyjęta, ale podaje się ją w pliku z informacją o statusie, ponieważ została wcześniej zgłoszona ze statusem PDNG. Należy zastosować kod ACPT.
108. Transakcji Txn2-1, Txn2-2, Txn2-3 i Txn2-5 nie podaje się w komunikacie z informacją o błędzie, ponieważ zostały przyjęte, a wcześniej nie przekazywano dla nich żadnego innego komunikatu zwrotnego. Transakcji Txn1-3 również nie podaje się w komunikacie z informacją o błędzie, ponieważ została ponownie zgłoszona, a chociaż w poprzednim zgłoszeniu transakcja miała status PDNG, to w przypadku ponownego zgłoszenia transakcji poddaje się ją walidacji tak, jak nowy raport o transakcji.
109. Transakcji Txn1-61 nie podaje się w komunikacie z informacją o błędzie. Status tej transakcji był podany w pliku przesłanym dnia 1 i od tej pory się nie zmienił.
110. Za dzień 2 stosuje się następujące raporty:

Dzień 8 (12/01/2016)

Dane referencyjne otrzymane przez ESMA dnia 05/01/16		
(Przekazane władzom krajowym o godz. 08:00 dnia 12/01/16)		
Nr instrumentu	Data dopuszczenia	Termin wygaśnięcia
Inst1	01/01/1980	
Inst2	01/01/2015	31/12/2030
Inst3	04/01/2016	
Inst4	04/01/2016	04/01/2016
Inst5	04/01/2016	
Inst7	10/01/2016	

Tabela tymczasowa (nieprzetworzone transakcje z pliku 1)			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn1-61	Inst6	04/01/2016	Odrzucony	Instrument nie dodany do danych referencyjnych w ciągu 7 dni

Plik z transakcjami 8			Wynik walidacji instrumentu	
Nr ref. transakcji	Instrument	Data transakcji	Przyj/Odrz/Ocze	Uwagi
Txn8-1	Inst1	11/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 11/01/16
Txn8-2	Inst2	11/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 11/01/16
Txn8-3	Inst3	12/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 12/01/16
Txn8-5	Inst5	12/01/2016	Przyjęty	Instrument ważny na dzień 12/01/16

111. Komunikat z informacją o statusie wysłany dnia 8 jest następujący:

Numer referencyjny transakcji	Status transakcji	Kod błędu	Komunikat o błędzie
Txn1-61	RJCT	CON-412	Instrument nie figuruje w danych referencyjnych na datę transakcji

112. Struktura XML komunikatu z informacją o statusie:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
```

```
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.031.001.01"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
```

```
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.031.001.01 auth.031.001.01.xsd">
```

```
<FinInstrmRptgStsAdv>
```

```
<MsgStsAdv>
```

```
<MsgRptIdr>TransactionFile8</MsgRptIdr>
```

```
<MsgSts>
```

```
<RptSts>ACPT</RptSts>
```

```
<Sttstcs>
```

```
<TtlNbOfRcrds>4</TtlNbOfRcrds>
```



```

        <NbOfRcrdsPerSts>
            <DtldNbOfTxs>4</DtldNbOfTxs>
            <DtldSts>ACPT</DtldSts>
        </NbOfRcrdsPerSts>
    </Sttstcs>
</MsgSts>
</MsgStsAdvc>
<MsgStsAdvc>
<MsgRptIdr>TransactionFile1</MsgRptIdr>
    <MsgSts>
        <RptSts>PART</RptSts>
        <Sttstcs>
            <TtlNbOfRcrds>1</TtlNbOfRcrds>
            <NbOfRcrdsPerSts>
                <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
                <DtldSts>RJCT</DtldSts>
            </NbOfRcrdsPerSts>
        </Sttstcs>
    </MsgSts>
    <RcrdSts>
        <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-61</OrgnlRcrdId>
        <Sts>RJCT</Sts>
        <VldtnRule>
            <Id>C0N-412</Id>
            <Desc>Instrument Inst6 nie figuruje w danych referencyjnych na
datę transakcji</Desc>
        </VldtnRule>
    </RcrdSts>
</MsgStsAdvc>
</FinInstrmRptgStsAdvc>
</Document>

```

113. Transakcja Txn1-61 została odrzucona, ponieważ instrument nie figuruje w danych referencyjnych i upłynął okres 7 dni od zgłoszenia transakcji. Należy zastosować status RJPD.

114. Pozostałe transakcje zostały przyjęte, ale nie podaje się ich w pliku z informacją o statusie, ponieważ żadna z nich nie miała wcześniej statusu PDNG.

6.3.4 Przykład nr 2

115. Komunikat z informacją o statusie zawierający informacje o komunikatach otrzymanych w dniu T i oczekujących na walidację instrumentu, dla którego dane referencyjne będą przekazane dnia T+1. Struktura XML pliku z informacją o statusie dla 100 transakcji o następującym statusie:

- a. 50 transakcji przyjęto

- b. 45 transakcji otrzymano
- c. 3 transakcji oczekuje (Txn1-51, Txn1-52, Txn1-61)
- d. 2 transakcji odrzucono (Txn 1-3, Txn 1-2)

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<Document xmlns="urn:iso:std:iso:2002:tech:xsd:auth.031.001.01"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"

xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:2002:tech:xsd:auth.031.001.01 auth.031.001.01.xsd">

<FinInstrmRptgStsAdv>

<MsgStsAdv>

<MsgRptIdr>TrasnactionFile1</MsgRptIdr>

<MsgSts>

<RptSts>PART</RptSts>

<Sttstcs>

<TtlNbOfRcrds>100</TtlNbOfRcrds>

<NbOfRcrdsPerSts>

<DtldNbOfTx>45</DtldNbOfTx>

<DtldSts>RCVD</DtldSts>

</NbOfRcrdsPerSts>

<NbOfRcrdsPerSts>

<DtldNbOfTx>3</DtldNbOfTx>

<DtldSts>PDNG</DtldSts>

</NbOfRcrdsPerSts>

<NbOfRcrdsPerSts>

<DtldNbOfTx>2</DtldNbOfTx>

<DtldSts>RJCT</DtldSts>

</NbOfRcrdsPerSts>

<NbOfRcrdsPerSts>

<DtldNbOfTx>50</DtldNbOfTx>

<DtldSts>ACPT</DtldSts>

</NbOfRcrdsPerSts>

</Sttstcs>

</MsgSts>

<RcrdSts>

<OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-3</OrgnlRcrdId>

<Sts>RJCT</Sts>

<VldtnRule>

<Id>C0N-411</Id>

<Desc>Instrument Inst1 nie figuruje w danych referencyjnych na

datę transakcji</Desc>

<Issr>Podmiot</Issr>

```

        </VldtnRule>
    </RcrdSts>
    <RcrdSts>
        <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-51</OrgnlRcrdId>
        <Sts>PDNG</Sts>
        <VldtnRule>
            <Id>CON-412</Id>
            <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
        </VldtnRule>
    </RcrdSts>
        <RcrdSts>
            <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-52</OrgnlRcrdId>
            <Sts>PDNG</Sts>
            <VldtnRule>
                <Id>CON-412</Id>
                <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
            </VldtnRule>
        </RcrdSts>
            <RcrdSts>
                <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-61</OrgnlRcrdId>
                <Sts>PDNG</Sts>
                <VldtnRule>
                    <Id>CON-412</Id>
                    <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
                </VldtnRule>
            </RcrdSts>
                <RcrdSts>
                    <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-2</OrgnlRcrdId>
                    <Sts>RJCT</Sts>
                    <VldtnRule>
                        <Id>CON-023</Id>
                        <Desc>Już wysłano dla firmy raport o transakcji z tym samym
numerem referencyjnym transakcji</Desc>
                        <Issr>Podmiot</Issr>
                    </VldtnRule>
                </RcrdSts>
            </MsgStsAdvc>
        </FinInstrmRptgStsAdvc>
    </Document>

```

6.4 Nagłówek Business Application Header

116. Nagłówek Business Application Header (BAH) został określony przez grupę użytkowników normy ISO 20022 i może stanowić element komunikatu merytorycznego wg ISO 20022. W szczególności BAH to definicja komunikatu zgodna z ISO 20022 (head.001.001.01), którą można połączyć z dowolną inną definicją komunikatu ISO 20022 w celu zbudowania komunikatu merytorycznego.
117. Nagłówek gromadzi w jednym miejscu dane dotyczące komunikatu, takie jak organizacja przesyłająca komunikat merytoryczny, organizacja otrzymująca komunikat, tożsamość samego komunikatu, odniesienie do innego komunikatu itp.
118. Nagłówek BAH ma umożliwiać spójne i przewidywalne przekazywanie takich danych wraz z komunikatem, niezależnie od czynników wdrożeniowych, jak wybór sieci.
119. Nagłówek BAH jest obowiązkowy w komunikatach z raportami o transakcjach.
120. W poniższej tabeli podano listę obowiązkowych elementów nagłówka BAH, które powinny znaleźć się w komunikacie, a także sposób ich wypełnienia:

Element	Opis	Zastosowanie w raportach podmiotów zgłaszających
Od	Nadawca komunikatu	OrganisationIdentification/Identification/OrganisationIdentification/Other/Identification: LEI podmiotu zgłaszającego
Do	Odbiorca komunikatu	OrganisationIdentification/Identification/OrganisationIdentification/Other/Identification: Kod kraju władzy właściwej
Business Message Identifier	Niepowtarzalny identyfikator komunikatu	Zasady wypełniania tego identyfikatora zostaną określone na szczeblu krajowym
Message Definition Identifier	Identyfikator typu komunikatu (identyfikator komunikatu ISO 20022).	Identyfikator odpowiedniego komunikatu ISO 20022 z zastosowaniem wyłącznie podstawie nazwy, np. auth.016.001.01 (a nie np. auth.016.001.01_raportowanie_krajowe) w przypadku komunikatu z danymi transakcji, auth.031.001.01 w przypadku komunikatu z informacją o statusie itp.
Data utworzenia	Data i czas utworzenia komunikatu merytorycznego	Data i czas w formacie ISO 8601.
Powiązany komunikat	Wskazanie nagłówka BAH komunikatu merytorycznego, z którym powiązany jest dany komunikat merytoryczny.	W przypadku komunikatu z informacją o statusie – kopia nagłówka BAH przywołanego komunikatu z danymi (umożliwia to powiązanie komunikatu o statusie i komunikatu z danymi).

121. Szczegółową dokumentację struktury komunikatu przedstawiono w Załączniku nr 2.

6.5 Nagłówek pliku merytorycznego

122. Jak wskazywano już wcześniej, każdy komunikat merytoryczny ISO 20022 (w przypadku raportowania transakcji zgodnie z MiFIR – komunikat z danymi transakcji lub komunikat zwrotny) należy przesyłać razem z nagłówkiem Business Application Header (BAH). Stanowią one odrębne komunikaty i powinny być pakowane w ramach dodatkowej struktury („koperty”) w celu utworzenia jednego pliku XML.

123. Nagłówek BAH to prosty plik XML zawierający BAH i komunikat merytoryczny:

Nagłówek pliku merytorycznego (koperta)

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BizData xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01">
  <Hdr>
```

BAH	<pre> <AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"> <Fr> ... </AppHdr></pre>
-----	---

```
</Hdr>
```

```
<PyId>
```

Komunikat merytoryczny	<pre> <Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.016.001.01"> <FinInstrmRptgTxRpt> <TxRpt> ... </TxRpt> </FinInstrmRptgTxRpt> </Document></pre>
------------------------	--

```
</PyId>
```

```
</BizData>
```

124. Struktura XML nagłówka pliku merytorycznego zawierająca BAH i raport o transakcji z podanym kodem ISIN (w tym przypadku nie stosuje się elementu „Powiązany komunikat”:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BizData xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01 head.003.001.01.xsd">
  <Hdr>
    <AppHdr xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01
head.001.001.01_ESMA_restricted.xsd">
      <Fr>
        <OrgId>
          <Id>
            <OrgId>
              <Othr>
                <Id>09876543210987654321</Id>
```

```

                <SchmeNm>
                    <Prtry>LEI</Prtry>
                </SchmeNm>
            </Othr>
        </OrgId>
    </Id>
</OrgId>
</Fr>
<To>
    <OrgId>
        <Id>
            <OrgId>
                <Othr>
                    <Id>PL</Id>
                    <SchmeNm>
                        <Prtry>Kod organu</Prtry>
                    </SchmeNm>
                </Othr>
            </OrgId>
        </Id>
    </OrgId>
</To>
<BizMsgIdr> </BizMsgIdr>
<MsgDefIdr>auth.016.001.01</MsgDefIdr>
<CreDt>2018-12-17T09:30:47Z</CreDt>
</AppHdr>
<Hdr>
<PyId>
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.016.001.01"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.016.001.01 auth.016.001.01.xsd">
    <FinInstrmRptgTxRpt>
        <Tx>
            <New>
                <TxId>ABCDEFGH123456</TxId>
                <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
                <InvstmtPtyInd>prawda</InvstmtPtyInd>
                <SubmitgPty>09876543210987654321</SubmitgPty>
                <Buyr>
                    <AcctOwnr>

```

```

                <Id>
                    <LEI>00987654321009876543</LEI>
                </Id>
            </AcctOwnr>
        </Buyr>
        <Sellr>
            <AcctOwnr>
                <Id>
                    <LEI>00098765432100098765</LEI>
                </Id>
            </AcctOwnr>
        </Sellr>
        <OrdTrnsmssn>
            <TrnsmssnInd>falsz</TrnsmssnInd>
        </OrdTrnsmssn>
        <Tx>
            <TradDt>2017-07-01T13:40:23Z</TradDt>
            <TradgCpcty>MT CH</TradgCpcty>
            <Qty>
                <Unit>1</Unit>
            </Qty>
            <Pric>
                <Pric>
                    <MntryVal>
                        <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
                    </MntryVal>
                </Pric>
            </Pric>
            <TradVn>XMIC</TradVn>
        </Tx>
        <FinInstrm>
            <Id>XX0000000001</Id>
        </FinInstrm>
        <ExctgPrsn>
            <Prsn>
                <CtryOfBrnch>PL</CtryOfBrnch>
            <Othr>
                <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id>
                <SchmeNm>

```

```

                <Prtry>CONCAT</Prtry>
            > </SchmeNm>
        </Othr>
    </Prsn>
</ExctgPrsn>
<AddtlAttrbts>
    <SciesFincgTxInd>prawda</SciesFincgTxInd>
</AddtlAttrbts>
</New>
</Tx>
</FinInstrmRptgTxRpt>

```

```
</Document>
```

```
</PyId>
```

```
</BizData>
```

125. Struktura XML nagłówka pliku merytorycznego zawierająca BAH i raport o transakcji z danymi referencyjnymi instrumentu finansowego (w tym przypadku nie stosuje się elementu „Powiązany komunikat”):

```

<BizData xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01 head.003.001.01.xsd">
    <Hdr>
<AppHdr xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns:n1="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01
head.001.001.01_ESMA_restricted.xsd">
    <Fr>
        <OrgId>
            <Id>
                <OrgId>
                    <Othr>
                        <Id>09876543210987654321</Id>
                        <SchmeNm>
                            <Prtry>LEI</Prtry>
                        </SchmeNm>
                    </Othr>
                </OrgId>
            </Id>
        </OrgId>
    </Fr>
    <To>
        <OrgId>

```



```

        <Id>
            <OrgId>
                <Othr>
                    <Id>PL</Id>
                    <SchmeNm>
                        <Prtry>Kod organu</Prtry>
                    </SchmeNm>
                </Othr>
            </OrgId>
        </Id>
    </OrgId>
</To>
<BizMsgIdr>FILE49019</BizMsgIdr>
<MsgDefIdr>auth.016.001.01</MsgDefIdr>
<CreDt>2018-12-17T09:30:47Z</CreDt>
</AppHdr>
</Hdr>
<PyId>
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth. 016.001.01"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth. 016.001.01 auth.016.001.01.xsd">
<FinInstrmRptgTxRpt>
    <Tx>
        <New>
            <TxId>ABCDEFGH123456</TxId>
            <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
            <InvstmtPtyInd>prawda</InvstmtPtyInd>
            <SubmitgPty>09876543210987654321</SubmitgPty> <Buyr>
                <AcctOwnr>
                    <Id>
                        <LEI>00987654321009876543</LEI>
                    </Id>
                </AcctOwnr>
            </Buyr>
            <Sellr>
                <AcctOwnr>
                    <Id>
                        <LEI>00098765432100098765</LEI>
                    </Id>
                </AcctOwnr>
            </Sellr>
        </New>
    </Tx>
</FinInstrmRptgTxRpt>
</Document>

```

```

</Sellr>
<OrdTrnsmssn>
  <TrnsmssnInd>falsz</TrnsmssnInd>
</OrdTrnsmssn>
<Tx>
  <TradDt>2017-07-01T13:40:23Z</TradDt>
  <TradgCpcty>MT CH</TradgCpcty>
  <Qty>
    <Unit>1</Unit>
  </Qty>
  <Pric>
    <Pric>
      <MntryVal>
        <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
      </MntryVal>
    </Pric>
  </Pric>
  <TradVn>XMIC</TradVn>
</Tx>
<FinInstrm>
  <Othr>
    <FinInstrmGnlAttrbts>
      <FullNm>FUTURE CONTRACT</FullNm>
      <ClsfctnTp>FFSCSX</ClsfctnTp>
    </FinInstrmGnlAttrbts>
    <DerivInstrmAttrbts>
      <PricMltplr>1</PricMltplr>
      <UndrlygInstrm>
        <Othr>
          <Sngl>
            <ISIN>GB0000000000</ISIN>
          </Sngl>
        </Othr>
      </UndrlygInstrm>
      <DlvryTp>CASH</DlvryTp>
    </DerivInstrmAttrbts>
  </Othr>
</FinInstrm>
<ExctgPrsn>
  <Prsn>

```

```

        <CtryOfBrnch>PL</CtryOfBrnch>
        <Othr>
            <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id>
            <SchmeNm>
                <Prtry>CONCAT</Prtry>
            > </SchmeNm>
        </Othr>
    </Prsn>
</ExctgPrsn>
<AddtlAttrbts>
    <SciesFincgTxInd>prawda</SciesFincgTxInd>
</AddtlAttrbts>
</New>
</Tx>
</FinInstrmRptgTxRpt>
</Document> </PyId>
</BizData>

```

126. Struktura XML nagłówka pliku merytorycznego zawierająca BAH i informację zwrotną o transakcjach z jednego pliku (w tym przypadku element „Powiązany komunikat” zawiera informację BAH danego pliku, a elementu „MsgRptIdr” nie stosuje się w pliku z informacją):

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BizData xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns:n2="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
xmlns:n1="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01 head.003.001.01.xsd">
    <Hdr>
<AppHdr xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns:n1="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01
head.001.001.01_ESMA_restricted.xsd">
    <Fr>
        <OrgId>
            <Id>
                <OrgId>
                    <Othr>
                        <Id>PL</Id>
                        <SchmeNm>
                            <Prtry>Kod organu</Prtry>
                        </SchmeNm>
                    </Othr>
                </OrgId>
            </Id>

```

```

        </OrgId>
    </Fr>
    <To>
        <OrgId>
            <Id>
                <OrgId>
                    <Othr>
                        <Id>09876543210987654321</Id>
                        <SchmeNm>
                            <Prtry>LEI</Prtry>
                        </SchmeNm>
                    </Othr>
                </OrgId>
            </Id>
        </OrgId>
    </To>
    <BizMsgIdr>FDB49019</BizMsgIdr>
    <MsgDefIdr>auth.031.001.01</MsgDefIdr>
    <CreDt>2018-12-18T14:11:03Z</CreDt>
    <Rltd>
        <Fr>
            <OrgId>
                <Id>
                    <OrgId>
                        <Othr>
                            <Id>09876543210987654321</Id>
                            <SchmeNm>
                                <Prtry>LEI</Prtry>
                            </SchmeNm>
                        </Othr>
                    </OrgId>
                </Id>
            </OrgId>
        </Fr>
        <To>
            <OrgId>
                <Id>
                    <OrgId>
                        <Othr>

```

```

                <Id>PL</Id>
                <SchmeNm>
                    <Prtry>Kod organu</Prtry>
                </SchmeNm>
            </Othr>
        </OrgId>
    </Id>
</OrgId>
</To>
<BizMsgIdr>FILE49019</BizMsgIdr>
<MsgDefIdr>auth.016.001.01</MsgDefIdr>
<CreDt>2018-12-17T09:30:47Z</CreDt>
</Rltd>
</AppHdr>
</Hdr>
<PyId>
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.031.001.01"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.031.001.01 auth.031.001.01.xsd">
    <FinInstrmRptgStsAdv>
        <MsgStsAdv>
            <MsgSts>
                <RptSts>PART</RptSts>
                <Sttstcs>
                    <TtlNbOfRcrds>8</TtlNbOfRcrds>
                    <NbOfRcrdsPerSts>
                        <DtldNbOfTxs>2</DtldNbOfTxs>
                        <DtldSts>RJCT</DtldSts>
                    </NbOfRcrdsPerSts>
                    <NbOfRcrdsPerSts>
                        <DtldNbOfTxs>3</DtldNbOfTxs>
                        <DtldSts>PDNG</DtldSts>
                    </NbOfRcrdsPerSts>
                </Sttstcs>
            </MsgSts>
            <RcrdSts>
                <OrgnlRcrdId>Txn1-3</OrgnlRcrdId>
                <Sts>RJCT</Sts>
                <VldtnRule>
                    <Id>C0N-411</Id>

```

```

    <Desc>Instrument Inst1 nie figuruje w danych referencyjnych na
datę transakcji</Desc>
    <Issr>Podmiot</Issr>
    <VldtnRule>
</RcrdSts>
<RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-51</OrgnlRcrdId>
    <Sts>PDNG</Sts>
    <VldtnRule>
        <Id>CON-412</Id>
        <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
    <VldtnRule>
</RcrdSts>
    <RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-52</OrgnlRcrdId>
    <Sts>PDNG</Sts>
    <VldtnRule>
        <Id>CON-412</Id>
        <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
    <VldtnRule>
</RcrdSts>
    <RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-61</OrgnlRcrdId>
    <Sts>PDNG</Sts>
    <VldtnRule>
        <Id>CON-412</Id>
        <Desc>Oczekiwanie na walidację instrumentu Inst5</Desc>
    <VldtnRule>
</RcrdSts>
    <RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>00987654321009876543Txn1-2</OrgnlRcrdId>
    <Sts>RJCT</Sts>
    <VldtnRule>
        <Id>CON-023</Id>
        <Desc>Już wysłano dla firmy raport o transakcji z tym
samym numerem referencyjnym transakcji</Desc>
    <Issr>Podmiot</Issr>
    <VldtnRule>
</RcrdSts>
</MsgStsAdvc>
</FinInstrmRptgStsAdvc>

```

</Document>

</PyId>

</BizData>

127. Struktura XML nagłówka pliku merytorycznego zawierająca BAH i informację zwrotną o transakcjach z wielu plików (w tym przypadku element „Powiązany komunikat” zawiera informację BAH ostatniego otrzymanego pliku, a element „MsgRptIdr” służy do identyfikacji każdego z otrzymanych plików):

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>

<BizData xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"

xmlns-'urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01"

xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01 head.003.001.01 .xsd">

<Hdr>

<AppHdr xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01
head.001.001.01_ESMA_restricted.xsd">

<Fr>

<OrgId>

<Id>

<OrgId>

<Othr>

<Id>DE</Id>

<SchmeNm>

<Prtry>Kod organu</Prtry>

</SchmeNm>

</Othr>

</OrgId>

</Id>

</OrgId>

</Fr>

<To>

<OrgId>

<Id>

<OrgId>

<Othr>

<Id>09876543210987654321</Id>

<SchmeNm>

<Prtry>LEI</Prtry>

</SchmeNm>

</Othr>

</OrgId>

</Id>

```

    </OrgId>
  </To>
  <BizMsgIdr>FeedbackFile2</BizMsgIdr>
  <MsgDefIdr>auth.031.001.01</MsgDefIdr>
  <CreDt>2018-12-16T11:24:33Z</CreDt>
  <Rltd>
    <Fr>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>09876543210987654321</Id>
              <SchmeNm>
                < Prtry>LEI</Prtry>
              </SchmeNm>
            </Othr>
          </OrgId>
        </Id>
      </OrgId>
    </Fr>
  </To>
  <OrgId>
    <Id>
      <OrgId>
        <Othr>
          <Id>DE</Id>
          <SchmeNm>
            < Prtry>Kod organu</Prtry>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </OrgId>
    </Id>
  </OrgId>
</To>
<BizMsgIdr>TransactionFile2</BizMsgIdr>
<MsgDefIdr>auth.016.001.01</MsgDefIdr>
<CreDt>2018-12-15T22:16:41 Z</CreDt>
</Rltd>
</AppHdr>

```



```

</Hdr>
<PyId>
<Document xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.031.001.01"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:auth.031.001.01 auth.031.001.01 .xsd">
  <FinInstrmRptgStsAdv>
    <MsgStsAdv>
      <MsgRptIdr>TransactionFile2</MsgRptIdr>
        <MsgSts>
          <RptSts>PART</RptSts>
          <Sttstcs>
            <TtlNbOfRcrds>6</TtlNbOfRcrds>
            <NbOfRcrdsPerSts>
              <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
              <DtldSts>RJCT</DtldSts>
            </NbOfRcrdsPerSts>
            <NbOfRcrdsPerSts>
              <DtldNbOrTxs>5</DtldNbOfTxs>
              <DtldSts>ACPT</DtldSts>
            </NbOfRcrdsPerSts>
          </Sttstcs>
        </MsgSts>
        <RcrdSts>
          <OrgnlRcrdId>09876543210987654321 Txn2-4</OrgnlRcrdId>
          <Sts>RJCT</Sts>
          <VldtnRule>
            <Id>CON-411</Id>
            <Desc>Instrument Inst4 nie figuruje w danych referencyjnych na
datę transakcji</Desc>
          </VldtnRule>
        </RcrdSts>
      </MsgStsAdv>
    <MsgStsAdv>
      <MsgRptIdr>TransactionFile1</MsgRptIdr>
        <MsgSts>
          <RptSts>PART</RptSts>
          <Sttstcs>
            <TtlNbOfRcrds>3</TtlNbOfRcrds>
            <NbOfRcrdsPerSts>
              <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>

```

```

        <DtldSts>ACPT</DtldSts>
    </NbOfRcrdsPerSts>
    <NbOfRcrdsPerSts>
        <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
        <DtldSts>RJCT</DtldSts>
    </NbOfRcrdsPerSts>
    <NbOfRcrdsPerSts>
        <DtldNbOfTxs>1</DtldNbOfTxs>
        <DtldSts>PDNG</DtldSts>
    </NbOfRcrdsPerSts>
</Sttstcs>
</MsgSts>
<RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>09876543210987654321 Txn1-
51</OrgnlRcrdId>
    <Sts>ACPD</Sts>
</RcrdSts>
<RcrdSts>
    <OrgnlRcrdId>09876543210987654321 Txn1-
52</OrgnlRcrdId>
    <Sts>RJCT</Sts>
    <VldtnRule>
    <Id>CON-411</Id>
    <Desc>Instrument Inst5 nie figuruje w danych
referencyjnych na datę transakcji</Desc>
    <VldtnRule>
</RcrdSts>
</MsgStsAdvc>
</FinInstrmRptgStsAdvc>
</Document>
</PyId>
</BizData>

```

128. Szczegółową dokumentację struktury komunikatu merytorycznego przedstawiono w Załączniku nr 2.

7 Załączniki

7.1 Załącznik nr 1

Zasady walidacji danych

Załączony dokument zawiera listę zasad walidacji składni i treści oraz odpowiednie kody błędów.

7.2 Załącznik nr 2

Schemy komunikatów

Załączony plik zip zawiera dokumentację i pliki XSD dla komunikatów służących do raportowania danych.