

Materiał informacyjny dotyczący systemu do obsługi zatwierdzonego mechanizmu sprawozdawczego (ARM - Approved Reporting Mechanism)**Spis treści**

Słownik pojęć.....	2
1. Cel usługi ARM.....	3
2. Zarys działania usługi ARM.....	3
3. Tryby raportowania.....	4
4. Identyfikacja FI w usłudze ARM.....	5
5. Schemat przepływu komunikatów w usłudze ARM.....	5
6. Kontrole merytoryczne raportów o transakcjach rejestrowanych w bazach ARM.....	8
7. Raportowanie w trybie uproszczonym.....	8
8. Raportowanie w trybie RT.....	14
9. Raportowanie w trybie Bezpośrednim.....	22
10. Raportowanie delegowane.....	22
11. Wymagane dane osobowe.....	23
12. Raportowanie przez ARM do Nadzorców.....	25
13. Proste przykłady raportowania.....	28
14. Opłaty.....	30
15. Załączniki.....	30

Słownik pojęć

FI – firma inwestycyjna zobowiązana do zgłaszania transakcji zgodnie z art. 26 rozporządzenia MIFIR

Usługa ARM – oferowana przez KDPW, jako zatwierdzony mechanizm sprawozdawczy, o którym mowa w art. 4 ust. 1 pkt 54 MIFID II (Approved Reporting Mechanism, ARM) usługa polegająca na zgłaszaniu szczegółów transakcji właściwym organom lub ESMA w imieniu FI

EMIR - Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) Nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji

MIFIR - Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) Nr 600/2014 Z Dnia 15 Maja 2014 r. w Sprawie Rynków Instrumentów Finansowych oraz Zmieniające Rozporządzenie (EU) Nr 648/2012

MIFID II - Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych oraz zmieniająca dyrektywę 2002/92/WE i dyrektywę 2011/61/UE

ESMA – European Securities and Markets Authority

RTS 22 – Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/590 z dnia 28 lipca 2016 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących zgłaszania transakcji właściwym organom.

Tabela 2 do RTS 22 – Tabela 2 załącznika 1 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/590 z dnia 28 lipca 2016 r. uzupełniającego rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących zgłaszania transakcji właściwym organom.

SHORTCODE - identyfikator wykorzystywany w zleceniach rynkowych i raportach przekazywanych bezpośrednio do KDPW przez FI do oznaczenia stron zawierających transakcję (kupujący, sprzedający) oraz innych podmiotów/osób występujących w raportach w polach: osoba podejmująca decyzję w imieniu kupującego/sprzedającego, decyzja inwestycyjna wewnątrz firmy, wykonanie wewnątrz firmy.

Uczestnik - Podmiot będący stroną zawartej umowy z KDPW dot. usługi ARM

Nadzorca - organ powołany przez każde państwo członkowskie zgodnie z art. 67 MIFID II

FIRD - Financial Instrument Reference Data

RT – usługa repozytorium transakcji oferowana przez KDPW

Raport - zgłoszenie lub anulowanie informacji o transakcji zawierające dane określone w tabeli 2 do RTS 22

1. Cel usługi ARM

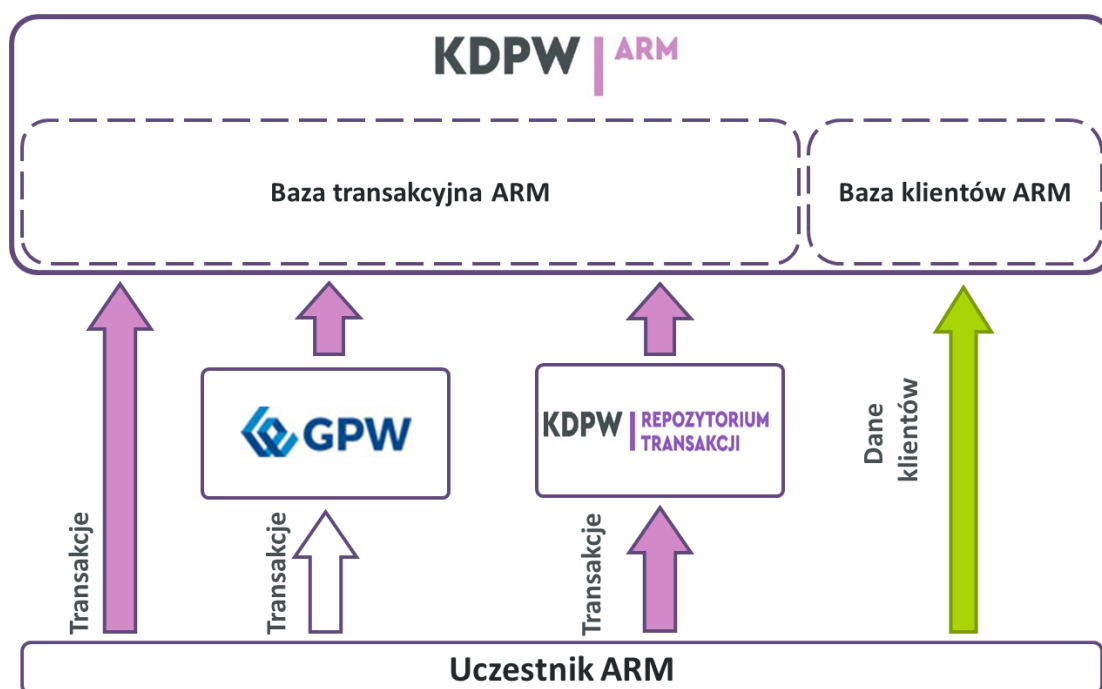
Celem usługi ARM jest umożliwienie firmom inwestycyjnym wywiązania się za pośrednictwem KDPW z obowiązku zgłaszania transakcji, o którym mowa w art. 26 MIFIR. Zgodnie z Rozporządzeniem (EU) 2016/1033 z dnia 23 czerwca 2016 roku zmieniającym Rozporządzenie MIFIR, obowiązek ten będzie mieć zastosowanie od dnia 3 stycznia 2018 r.

Raporty o transakcjach zawartych w dniu T powinny być przekazane do Nadzorca najpóźniej do końca dnia T+1. Baza instrumentów finansowych publikowana przez ESMA, tzw. Financial Instrument Reference Data (FIRD) określać będzie zakres instrumentów, które podlegają obowiązkowi zgłaszania do Nadzorca. Będzie ona tworzona na podstawie danych (dot. instrumentów finansowych notowanych w systemach obrotu oraz indeksów) otrzymywanych poprzedniego dnia, od Nadzorca w danej jurysdykcji. Jako podlegające obowiązkowi raportowania kwalifikowane są więc transakcje zawarte w instrumentach publikowanych na liście FIRD lub w instrumentach opartych o instrument bazowy, którym jest instrument publikowany na liście FIRD. KDPW nie będzie dokonywać kontroli w zakresie kwalifikacji transakcji objętych obowiązkiem raportowania. Kontrola taka, zgodnie z przyjętymi założeniami powinna zostać zapewniona przez Nadzorcę, w okresie 7 dni kalendarzowych od dnia otrzymania raportu. Oznacza to, że KDPW - w imieniu FI - prześle Nadzorca wszystkie raporty, niezależnie od instrumentu będącego przedmiotem transakcji.

KDPW, dążąc do stworzenia kompleksowej oferty w zakresie wypełniania obowiązków raportowych, podjął działania mające na celu uruchomienie usługi ARM. Szczegóły modelu usługi ARM, której uruchomienie planowane jest przez KDPW przedstawione są w niniejszym materiale. Dodatkowo, w zał. IX zdefiniowane zostały obszary i funkcjonalności, których realizacja zależna jest od konsultacji rynkowych.

2. Zarys działania usługi ARM

2.1 Schemat usługi ARM



2.2 Funkcjonalności usługi ARM

- Odbieranie i przechowywanie raportów o transakcjach składanych przez FI;
- Przeprowadzanie kontroli formalnych i merytorycznych otrzymanych raportów;
- Budowanie raportów na podstawie danych transakcyjnych z rynków i z RT;
- Przekazywanie raportów do Nadzorca;
- Przekazywanie FI kopii raportu przekazanego do Nadzorca;
- Informowanie o statusie raportu nadanym przez Nadzorcę oraz o statusie raportu po przeprowadzonych kontrolach: formalnej i merytorycznej.

3. Tryby raportowania

Niezależnie od trybu raportowania korzystanie z usługi ARM możliwe będzie wyłącznie po zawarciu umowy z KDPW lub skorzystanie z usług podmiotu pośredniczącego - reprezentanta. Szczegółowe zasady świadczenia usługi ARM określone zostaną w regulaminie usługi.

Dodatkowo, w Regulaminie RT zostaną dokonane zmiany określające prawa i obowiązki uczestników RT w zakresie raportowania zgodnie z MIFIR.

W ramach usługi ARM funkcjonować będą następujące tryby raportowania:

- I. Tryb Uproszczony
- II. Tryb Bezpośredni
- III. Tryb RT

Konfiguracja uczestnika w różnych trybach raportowania będzie możliwa w oparciu o różne kody Instytucji.

3.1. Tryb Uproszczony

W tym trybie raportowane będą transakcje zawierane na GPW. Tryb dedykowany wyłącznie dla FI będących członkami GPW.

Raportowanie w trybie uproszczonym zostało szerzej omówione w rozdziale *Raportowanie w trybie uproszczonym*.

3.2. Tryb Bezpośredni

W tym trybie przewiduje się raportowanie bezpośrednio przez FI, tzn. przekazanie pełnej informacji wymaganej w Załączniku 1 do RTS 22 bezpośrednio za pomocą komunikatu do KDPW (kanałem U2A (user to application) bądź A2A (application to application)). Dopuszcza się jednocześnie przekazanie pełnego raportu z danymi osobowymi albo raportu z wykorzystaniem SHORTCODE.

Raportowanie w trybie Bezpośrednim zostało szerzej omówione w rozdziale *Raportowanie w trybie Bezpośrednim*.

3.3. Tryb RT

Trybem RT objęte będą raporty o transakcjach w instrumentach pochodnych, przesyłane przez uczestników RT, które są objęte obowiązkami raportowania wynikającymi z art. 9 EMIR i art. 26 MiFIR. KDPW pełniąc jednocześnie rolę RT i ARM przekaże informacje odebrane od uczestnika RT, uzupełnione o dane wymagane RTS22, do Nadzorca, pozwalając jednocześnie FI wypełnić obowiązek raportowania wynikający z MIFIR.

Tryb RT, nie będzie obejmował raportów przesyłanych do RT przez KDPW_CCP w imieniu Uczestników KDPW_CCP. Raporty dotyczące tych transakcji będą tworzone w ramach trybu uproszczonego na podstawie danych transakcyjnych pozyskanych bezpośrednio z GPW.

Tryb RT nie będzie również obejmował przekazywania raportów z rynku kasowego, gdyż nie podlegają one obowiązkowi raportowania wynikającemu z art. 9 EMIR. Dane z rynku kasowego będą mogły być przekazane do KDPW z użyciem kodu uczestnika RT w trybie Bezpośrednim za pomocą komunikatu auth.016 lub auth.rpt.

Raportowanie w trybie RT zostało szerzej omówione w rozdziale Raportowanie w trybie RT.

4. Identyfikacja FI w usłudze ARM

W ramach usługi ARM, FI jako osoba prawna oznaczona będzie kodem LEI. Zakłada się, że oddziały zagranicznych spółek w celu uzyskania uczestnictwa w usłudze ARM wystąpią o kod LEI, o ile GLEIF¹ umożliwi nadawanie identyfikatorów tym jednostkom.

Jednocześnie dana FI będzie mogła występować jednocześnie pod kilkoma kodami instytucji. W szczególności będą to Instytucje pod kodami występującymi obecnie jako uczestnicy rynków lub uczestnicy RT.

5. Schemat przepływu komunikatów w usłudze ARM

Komunikacja pomiędzy KDPW, Nadzorcą i uczestnikami usługi ARM będzie bazować na opublikowanych przez ESMA komunikatach ISO20022 do wymiany danych z Nadzorcami. Powołane zostaną także dodatkowe komunikaty służące do przesyłania informacji pomiędzy uczestnikami usługi a KDPW.

Uczestnicy usługi ARM będą mogli przysyłać informacje w trybie Bezpośrednim za pomocą następujących komunikatów:

- auth.016. – komunikat, służący do przekazania raportu, zawierający komplet danych do wysłania do Nadzorca – zał. II;
- auth.rpt. - raport auth.016.001.01 rozszerzony o pola umożliwiające przekazywanie kodów SHORTCODE zamiast pełnych danych osobowych – zał. VIII;
- auth.clt. – komunikat służący do przekazywanych danych dla osób, podmiotów oznaczonych w raportach SHORTCODE – zał. VII.

Uczestnicy RT będą przekazywać raporty objęte obowiązkiem wynikającym z MIFIR za pomocą komunikatu trar.ins, który zostanie rozszerzony o pola umożliwiające przekazanie informacji wynikających z MIFIR, których nie wymaga się w EMIR. W komunikacie trar.ins. możliwe będzie identyfikowanie podmiotów/osób za pomocą SHORTCODE, a informacje o podmiotach/osobach oznaczonych tym identyfikatorem uczestnik RT prześle do KDPW za pomocą komunikatu auth.clt.

Uczestnicy bezpośredni KDPW korzystający z trybu uproszczonego będą mogli przekazać dodatkowe informacje do raportów transakcji giełdowych za pomocą poniższych komunikatów:

- auth.clt. – komunikat służący do przekazywanych danych dla osób.podmiotów oznaczonych w raportach SHORTCODE;

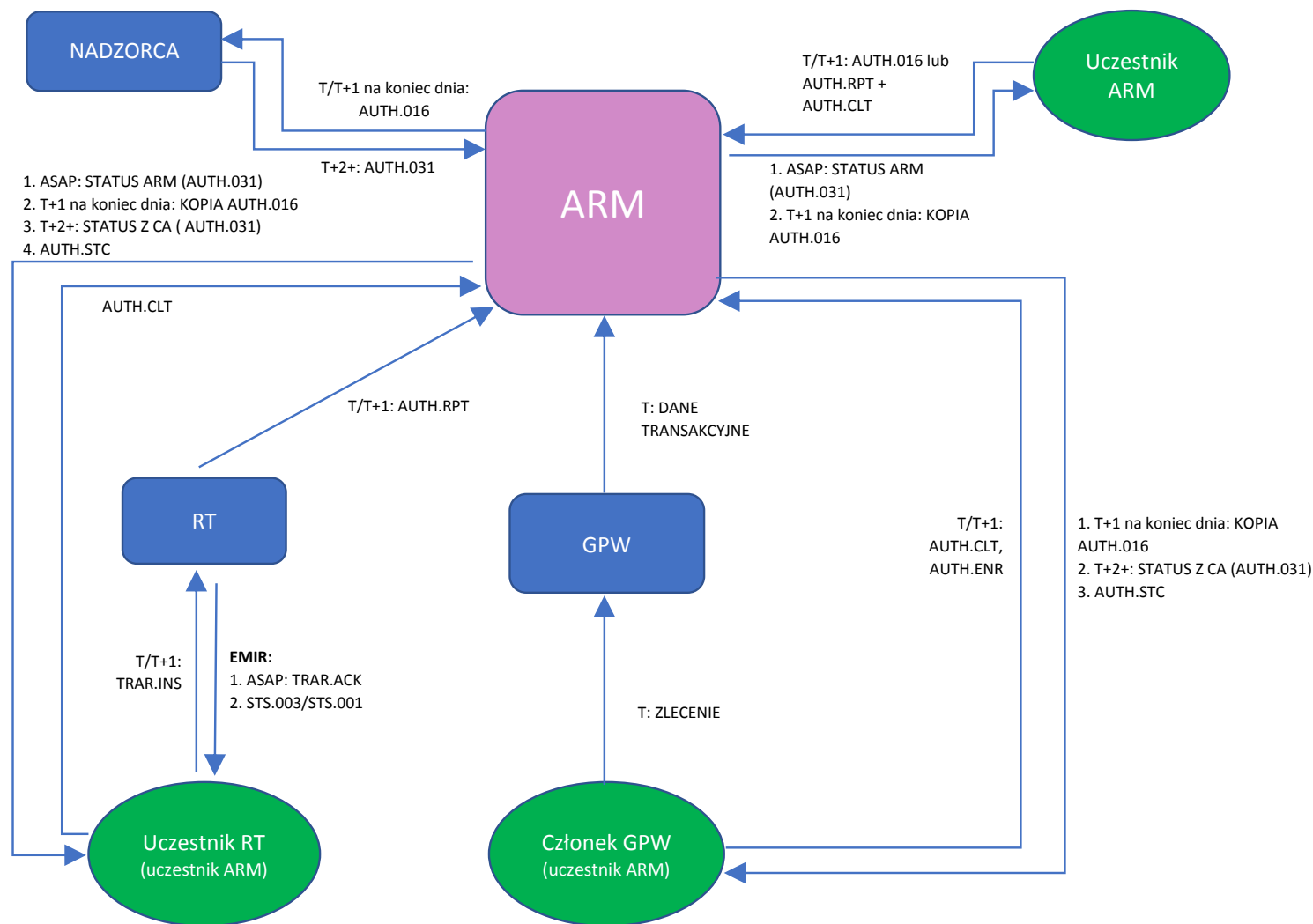
¹ GLEIF (Global Legal Entity Identifier Fundation) – organizacja non-profit, będąca jednostką operacyjną Global LEI System, której głównym zadaniem jest zapewnienie integralności operacyjnej Global LEI System.

- auth.enr. - komunikat uzupełniający, służący do przekazania dodatkowych informacji transakcyjnych, które nie występują w systemach GPW/KDPW.

Zbiór komunikatów zwrotnych w usłudze ARM obejmuje:

- auth.031 - informujący o poprawności raportu bądź ze wskazaniem błędu po przejściu walidacji. Ten sam komunikat będzie wykorzystany również do przekazania statusu raportu otrzymanego od Nadzorca;
- auth.016 –komunikat zwrotny do uczestnika usługi ARM zawierający kopię raportu przekazanego do nadzorca (raport do nadzorca będzie wysyłany pod warunkiem jego poprawnego przetworzenia);
- auth.stc – komunikat statusowy do komunikatu auth.clt – zał. X.

DIAGRAM PRZEŁYWU KOMUNIKATÓW W USŁUDZE ARM



6. Kontrole merytoryczne raportów o transakcjach rejestrowanych w bazach ARM

Komunikaty przychodzące do KDPW, zgłaszane przez uczestnika usługi ARM w trybie Bezpośrednim lub trybie RT, a także dane generowane w trybie uproszczonym podlegać będą zdefiniowanym regułom walidacji. Przewiduje się 2 poziomy kontrole: kontrole formalne (weryfikacja na poziomie schematu XML) oraz kontrole merytoryczne – zaimplementowane na poziomie oprogramowania przetwarzającego komunikat oraz dane wejściowe.

W szczególności kontrole dla komunikatów auth.016 i auth.rpt będą zgodne z zasadami walidacji opublikowanymi przez ESMA w dokumentach: Zasady walidacji (Załącznik I) oraz DRAFT15auth.016.001.01_ESMAUG_Reporting_1.0.2 z dn. 31 stycznia 2017r. (Załącznik II).

Wyjątek stanowi kontrola pola 41, w którym KDPW w ramach usługi ARM walidować będzie jedynie cyfrę kontrolną ISIN. Kontrola zgodności ISIN z listą w bazie referencyjnej ESMA leży wyłącznie w gestii Nadzorczy.

KDPW będzie wykonywał kontrole dotyczące następujących obszarów:

- kontrole komunikatów z raportem transakcji (auth.016, auth.rpt),
- kontrole komunikatów uzupełniających do transakcji rynkowych (auth.enr),
- kontrole komunikatów z danymi klienta (auth.clt),

7. Raportowanie w trybie uproszczonym

7.1. Założenia ogólne

W ramach trybu uproszczonego KDPW zbuduje raporty przesyłane do Nadzorczy w oparciu o dane transakcyjne pochodzące z systemów GPW.

W tym trybie zakłada się wykorzystanie SHORTCODE jako **niezbędnego** identyfikatora do oznaczania danych osobowych stron zawierających transakcję (kupujący, sprzedający) oraz innych podmiotów/osób występujących w raportach w polach: osoba podejmująca decyzję w imieniu kupującego/sprzedającego, decyzja inwestycyjna wewnątrz firmy, wykonanie wewnątrz firmy. Dane osobowe podmiotu/osoby oznaczonej danym identyfikatorem SHORTCODE będą mogły być przekazane przez uczestnika usługi ARM do KDPW komunikatem auth.clt.

Dane transakcyjne, które są wymagane RTS22, a których KDPW nie otrzyma w plikach transakcyjnych z GPW mogą zostać przekazane przez uczestnika ARM za pomocą komunikatu auth.enr.

W trakcie generowania raportów KDPW nada unikalny identyfikator TRN (pole 2 tabeli 2 do RTS 22). Aby uniknąć możliwości zdublowania identyfikatora z identyfikatorami nadawanymi przez FI dla transakcji spoza rynku, KDPW przekaże zasady tworzenia TRN. Zakłada się, że wszystkie TRN raportów tworzonych przez KDPW będą rozpoczynały się prefix-em KDPWARM .

Zakłada się, że w przypadku raportów o instrumentach pochodnych zawartych na GPW, przekazywanych do RT przez KDPW_CCP w imieniu uczestników KDPW_CCP, KDPW nie będzie pozyskiwał danych bezpośrednio z systemu RT. Raporty z rynku derywatów będą generowane bezpośrednio na podstawie danych transakcyjnych pozyskanych z systemów GPW (analogicznie jak z rynku kasowego).

Raporty powstałe w ramach trybu uproszczonego będą składane do Nadzorczy i równolegle przekazywane jako kopia raportu do FI (auth.016).

7.2. Raporty transakcji z rynku regulowanego

7.2.1. Źródła pozyskiwania danych do raportowania z rynku regulowanego

Poniższa tabela zawiera roboczą wersję ustaleń z GPW w zakresie źródeł pozyskiwania danych z rynku regulowanego – GPW. Źródłami tymi są:

- Dane tworzone przez KDPW na podstawie baz referencyjnych innych niż baza danych podmiotów, danych osobowych oraz na podstawie reguł domyślnych;
- Dane z bazy referencyjnej Klientów zasilanej z pliku danych osobowych przekazywanych bezpośrednio przez FI do KDPW;
- Dane w plikach posesyjnych z rynku, odbieranych przez KDPW bezpośrednio z GPW;
- Dane z komunikatu uzupełniającego przekazywanego przez FI do KDPW – auth.enr;
- Zakłada się, że GPW przekaże dane transakcyjne do KDPW w dniu T+1 maksymalnie do godziny X (planowana godzina przedpołudniowa), po uprzednim wykonaniu rekonyliacji danych SHORTCODE – long code wykonanej z Uczestnikami GPW w przypadku wykrycia niezgodności w zleceniach / bazie klientów;
- Uprawnienie KDPW do budowania raportów na bazie danych transakcyjnych otrzymanych z GPW będzie wynikało z deklaracji złożonej przez FI;
- KDPW przeprowadzi techniczny proces wprowadzający KDPW_CCP między oryginalne strony transakcji;
- Kod Instytucji w ramach mechanizmu uproszczonego będzie tym samym 4-znakowym kodem instytucji jakim oznaczani są uczestnicy rynku (GPW). Kopia raportu (auth.016) będzie przekazywana trybem bezpośrednim;
- W przypadku, gdy uczestnik usługi ARM złoży deklarację korzystania z mechanizmu budowania raportów z rynku regulowanego przez KDPW, w sytuacji gdy nie uda się zbudować raportu w wyznaczonym terminie (np. brak danych Klienta), KDPW przekaże trybem bezpośrednim komunikat auth.031 do uczestnika usługi ARM wraz z podaniem przyczyny braku budowy raportu. W takich przypadkach FI powinna zaraportować wskazaną transakcję w trybie bezpośrednim.

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr
1	Report status	X			
2	Transaction Reference Number			X	
3	Trading venue transaction identification code			X	
4	Executing entity identification code			X	

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr
5	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU	X			
6	Submitting entity identification code	X			
7	Buyer identification code			X	
8	Country of the branch for the buyer		X		
9	Buyer - first name(s)		X		
10	Buyer - surname(s)		X		
11	Buyer - date of birth		X		
12	Buyer decision maker code				X
13	Buy decision maker - First Name(s)		X		
14	Buy decision maker – Surname(s)		X		
15	Buy decision maker - Date of birth		X		
16	Seller identification code			X	
17	Country of the branch for the seller		X		
18	Seller - first name(s)		X		
19	Seller - surname(s)		X		
20	Seller - date of birth		X		
21	Seller decision maker code				X

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr
22	Sell decision maker - First Name(s)		X		
23	Sell decision maker – Surname(s)		X		
24	Sell decision maker - Date of birth		X		
25	Transmission of order indicator				X
26	Transmitting firm identification code for the buyer				X
27	Transmitting firm identification code for the seller				X
28	Trading date time			X	
29	Trading capacity			X	
30	Quantity			X	
31	Quantity currency			X	
32	Derivative notional increase/decrease	X			
33	Price			X	
34	Price Currency			X	
35	Net amount	X			
36	Venue			X	
37	Country of the branch membership		X		
38	Up-front payment	X			
39	Up-front payment currency	X			
40	Complex trade component id				X

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr
41	Instrument identification code			X	
42	Instrument full name	X			
43	Instrument classification	X			
44	Notional currency 1	X			
45	Notional currency 2	X			
46	Price multiplier	X			
47	Underlying instrument code	X			
48	Underlying index name	X			
49	Term of the underlying index	X			
50	Option type	X			
51	Strike price	X			
52	Strike price currency	X			
53	Option exercise style	X			
54	Maturity date	X			
55	Expiry date	X			
56	Delivery type	X			
57	Investment decision within firm			X	
58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision		X		
59	Execution within firm			X	
60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution		X		

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr
61	Waiver indicator			X	
62	Short selling indicator				X
63	OTC post-trade indicator	X			
64	Commodity derivative indicator	X			
65	Securities financing transaction indicator	X			

7.2.2. Zasady wypełniania pól w raporcie do Nadzorczy, dla których wartość tworzona jest w KDPW

Zasady wypełniania danych na podstawie baz referencyjnych innych niż baza Klientów oraz reguł domyślnych.

- Pole 1 'NEWT' – New ; 'CANC' – Cancellation.
- Pole 5: Zakłada się, że wszyscy uczestnicy (działający na rynku regulowanym) są FI, zatem wartość zawsze równa 'true'.
- Pole 6. Stała wartość: LEI KDPW: 259400L3KBYEVNHEJF55 .
- Pole 32. Nie dotyczy transakcji z rynku regulowanego, w związku z czym w raporcie do Nadzorczy tag będzie pominięty.
- Pole 35.
 - pole dotyczy instrumentów dłużnych
 - Dla instrumentów dłużnych wartość ta będzie iloczynem wartości z pola nr 30 - Quantity – i wartości rynkowej instrumentu wyznaczonej przez KDPW.
- Pola 38 – 39. Nie dotyczy transakcji z rynku, w związku z czym w raporcie do Nadzorczy sekcja/tagi będą pomijane.
- Pola 42 – 56. Nie dotyczy transakcji, dla których znany jest ISIN instrumentu , w związku z czym w raporcie do Nadzorczy sekcja/tagi będą pomijane. W trybie uproszczonym pola nigdy nie będą wypełniane.
- Pola 42 – 56. Nie dotyczy transakcji z rynku GPW, w związku z czym w raporcie do Nadzorczy sekcja/tagi będą pomijane. W trybie uproszczonym pola zawsze pomijane.
- Pole 63 – Pole będzie pomijane w raporcie. Transakcje z rynku nie są transakcjami OTC.
- Pole 64 – Pole będzie pomijane w raporcie – dotyczy wyłącznie derywatów towarowych.
- Pole 65 – zawsze 'false'. Dotyczy transakcji podlegających pod SFTR.

7.2.3. Przetwarzanie danych z komunikatu uzupełniającego dot. transakcji otrzymanych od FI

Zakłada się, że jeśli komunikat uzupełniający nie dotrze do określonej godziny, która zostanie wskazana w regulaminie usługi lub określony tag / sekcja nie zostaną w nim wypełnione, to wszystkie lub część pól raportu składanego do Nadzorca będzie wypełniana domyślnie przez KDPW.

Dane uzupełniające będą przekazywane dedykowanym komunikatem auth.enr – załącznik III. Procesowanie poszczególnych pól będzie wykonywane w następujący sposób.

- Pole 12. Jeśli w określonym czasie KDPW nie otrzyma komunikatu od FI lub dedykowany tag zostanie pominięty w otrzymanym komunikacie uzupełniającym, wówczas pole zostanie pominięte w raporcie. W przypadku otrzymania danej od FI w komunikacie uzupełniającym (przesłanym w umówionym czasie) wartość w polu zostanie uzupełniona na podstawie wskazanego przez FI SHORTCODE.
- Pole 21. Jeśli w określonym czasie KDPW nie otrzyma komunikatu od FI lub dedykowany tag zostanie pominięty w otrzymanym komunikacie uzupełniającym, wówczas pole zostanie pominięte w raporcie. W przypadku otrzymania danej od FI w komunikacie uzupełniającym (przesłanym w umówionym czasie) wartość w polu zostanie uzupełniona na podstawie wskazanego SHORTCODE.
- Pole 25:
 - „true” – gdy w określonym czasie KDPW otrzyma komunikat od FI, w którym w dedykowanym polu komunikatu uzupełniającego występować będzie wartość „true”
 - „false” – gdy w określonym czasie KDPW otrzyma komunikat uzupełniający od FI, w którym jest wartość „false” lub w określonym czasie nie zostanie przesłana żadna informacja, tj. nie otrzyma komunikatu lub otrzyma komunikat, w którym dedykowany tag zostanie pominięty.
- Pole 26. Jeśli w określonym czasie KDPW nie otrzyma komunikatu od FI lub dedykowany tag zostanie pominięty w otrzymanym komunikacie uzupełniającym to zostanie pominięty i wówczas pole to nie będzie wypełniane w raporcie do Nadzorca. W przypadku otrzymania danej od FI w komunikacie uzupełniającym dana zostanie uzupełniona na podstawie wskazanego SHORTCODE.
- Pole 27. Jeśli w określonym czasie KDPW nie otrzyma komunikatu od FI lub dedykowany tag zostanie pominięty w otrzymanym komunikacie uzupełniającym to zostanie pominięty i wówczas pole to nie będzie wypełniane w raporcie do Nadzorca. W przypadku otrzymania danej od FI w komunikacie uzupełniającym dana zostanie uzupełniona na podstawie wskazanego SHORTCODE.
- Pole 62.
 - Zgodnie z wartością przekazaną w dedykowanym tag-u w komunikacie uzupełniającym od FI – gdy w określonym czasie KDPW otrzyma komunikat od FI;
 - ‘UNDI’ – gdy w określonym czasie KDPW otrzyma komunikat uzupełniający od FI, w którym jest wartość „UNDI” lub w określonym czasie nie zostanie przesłana żadna informacja, tj. nie otrzyma komunikatu lub otrzyma komunikat, w którym dedykowany tag zostanie pominięty.

8. Raportowanie w trybie RT

8.1. Sposób przekazywania raportów

Raporty składane przez uczestnika RT będą mogły być składane za pośrednictwem rozszerzonego komunikatu własnego XML (trar.ins.) zapewniającego możliwość jednoczesnego wypełnienia obowiązków EMIR i MIFIR. Uczestnik raportujący wskaże którego obowiązku/-ów dotyczy raport za pomocą odpowiedniego pola – znacznika REG (E- EMIR, M-MIFIR, B-oba). Zakłada się, że brak znacznika oznacza raport tylko dla EMIR. W komunikacie przekazywanym do RT zostaną dodane sekcje obowiązkowe dla raportów oznaczonych znacznikiem B lub M, w których uczestnik przekaze informacje wymagane pod

MIFIR. W komunikacie oznaczonym REG=B (wspólnym dla obu regulacji) sekcja General Information będzie wspólna dla obydwu regulacji, sekcje (jedna lub dwie) – Counterparty Information będzie wspólna dla obu regulacji (w przypadku powtórzenia sekcji, ARM wygeneruje raporty za obie strony), sekcja Valuation and Collateral obejmie tylko dane EMIR, sekcja Trade data details będzie wspólna dla obu regulacji.

Wszystkie walidacje merytoryczne wynikające z wymagań regulacji MIFIR zaimplementowane będą na poziomie usługi ARM, a RT będzie walidować schemat XSD oraz stosować kontrole merytoryczne wymagane w EMIR, na dotychczasowych zasadach. Informacje zwrotne trafią do uczestnika kanałem RT w formie komunikatu statusowego auth.031 a kopia przesłanego przez KDPW do Nadzorca raportu zostanie przekazana w formie komunikatu auth.016 w momencie przekazania raportu przez KDPW. Po odebraniu komunikatu statusowego od Nadzorca, KDPW prześle go do uczestnika RT.

8.2. Obsługa poszczególnych rodzajów zmian (AT)

Przewiduje się poniższe opcje rejestracji raportów AT=N w RT:

1. Uczestnik wysyła komunikat dotyczący tylko EMIR (REG=E), tzn. sekcje obowiązkowe dla MIFIR nie są wypełnione (jeśli są wypełnione będą ignorowane). Wtedy następuje standardowa obsługa komunikatu obowiązująca w RT.
2. Uczestnik wysyła komunikat dotyczący obu regulacji (REG=B), z wypełnioną sekcją MIFIR.
RT waliduje schemat komunikatu – jeśli schemat jest błędny to odrzuca komunikat.
Jeśli schemat jest poprawny, to RT waliduje merytorycznie sekcję EMIR. Jeśli sekcja EMIR jest niepoprawna to komunikat jest odrzucany. Jeśli kontrole EMIR są poprawne to informację o transakcji zapisuje w bazie RT i wysyła do uczestnika RT komunikat zwrotny trar.sts. RT generuje komunikat o transakcji do ARM (z wykorzystaniem SHORTCODE, bądź z całym zestawem danych osobowych – w zależności od wybranej przez uczestnika opcji przekazywania danych osobowych).
3. Uczestnik wysyła komunikat dotyczący tylko MIFIR (REG=M).
RT waliduje schemat XSD; jeśli jest błędny to odrzuca komunikat. Jeśli schemat jest poprawny, to RT sprawdza, czy raport o podanym kluczu EMIR (UTI, CP1, CP2) zapisany jest w bazie RT; jeśli nie, to RT odrzuca komunikat; jeśli tak, to RT generuje komunikat do ARM, przy czym dane z sekcji MIFIR uzupełnione są o dane z bazy RT, nawet jeśli wypełniono pola w sekcjach EMIR komunikatu trar.ins.

Celem zachowania spójności danych utrzymywanych w RT z danymi przekazywanymi do nadzorców pod MIFIR (RT rejestruje wyłącznie transakcje podlegające raportowaniu zgodnie z EMIR) zakłada się, że wskazanie Action Type (AT), przekazywanego w każdym komunikacie trar.ins.001, będzie wskazywało procesowanie zarówno związane z raportowaniem wynikającym z EMIR jak i sposób generowania komunikatów do ARM przez RT, zgodnie ze wskazówkami w poniższej tabeli, w zależności od znacznika REG.

Tabela 8a: Sposób obsługi raportów wchodzących do RT w zależności od AT i znacznika REG		
EMIR: Action Type	REG	Działanie RT
N - New	E	RT zapisuje informacje w bazie EMIR; RT nie generuje komunikatu do ARM; sekcje MIFIR są ignorowane
	M	RT generuje komunikat o statusie raportu=NEW do ARM, przy czym pola z sekcji MIFIR uzupełnia o przesłane wcześniej dane z bazy RT, po sprawdzeniu, że takie istnieją. Jeśli brak transakcji w bazie EMIR to komunikat jest odrzucany.

Tabela 8a: Sposób obsługi raportów wchodzących do RT w zależności od AT i znacznika REG		
EMIR: Action Type	REG	Działanie RT
	B	RT zapisuje informacje w bazie EMIR i generuje komunikat do ARM: NEW
M – Modify	nie wymagany	RT zapisuje informacje w bazie EMIR; RT nie generuje komunikatu do ARM; sekcje MIFIR są ignorowane
C – Early Termination	nie wymagany	RT zapisuje informacje w bazie EMIR; RT nie generuje komunikatu do ARM; sekcje MIFIR są ignorowane
E – Error	E,B	RT zapisuje informacje (AT=E) w bazie EMIR; RT generuje komunikat do ARM: CANCEL i oznacza raport w bazie EMIR jako CANCEL (pole flaga).
	M	RT nie zapisuje AT=E w bazie EMIR, ale generuje komunikat do ARM: CANCEL i oznacza raport w bazie EMIR jako CANCEL (pole flaga).
R – Correction	E	RT zapisuje informacje w bazie EMIR; RT nie generuje komunikatu do ARM; sekcje MIFIR są ignorowane
	M	RT generuje komunikaty CANCEL i NEW do ARM; przy czym dane w komunikacie NEW pochodzą z sekcji MIFIR komunikatu, uzupełnionymi o dane w bazie RT;
	B	RT zapisuje AT=R do bazy EMIR i na podstawie danych przekazanych w komunikacie oraz danych w bazie EMIR (po zmianach) generuje do ARM 2 komunikaty: CANCEL i NEW. W takich przypadkach uczestnik może podać tylko modyfikowane pola EMIR (pozostałe zostaną uzupełnione z bazy RT), ale jednocześnie wypełniając komplet danych MIFIR.
Z – Compression	nie wymagany	RT zapisuje informacje w bazie EMIR; RT nie generuje komunikatu do ARM; sekcje MIFIR są ignorowane
V- Valuation	nie wymagany	RT zapisuje informacje w bazie EMIR; RT nie generuje komunikatu do ARM; sekcje MIFIR są ignorowane
P – Position Component	nie wymagany	RT zapisuje informacje w bazie EMIR; RT nie generuje komunikatu do ARM; sekcje MIFIR są ignorowane

8.3. Uzupełnianie informacji potrzebnych do wypełnienia obowiązków raportowych wynikających z MIFIR

W raporcie wskazanym do raportowania pod MIFIR (REG=M lub B), uczestnik wypełnia (we właściwych sekcjach) wszystkie informacje potrzebne do wygenerowania raportu MIFIR, których nie podał w sekcji EMIR (zgodnie z poniższą tabelą).

Oznaczenia sekcji komunikatu trar.ins użyte w tabeli:

- 1 – General Information,
- 2 - Counterparty Information,
- 3 – Valuation and Collateral,
- 4 – Trade Details.

Tabela 8b: Źródła danych w komunikacie tworzonym przez RT do ARM				
Nr	FIELD	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	NEW EMIR RTS Field name	SEKCJA w obecnym komunikacie trar.ins
1	Report status	'NEWT' - New 'CANC' - Cancellation	Na podstawie Action type	
2	Transaction Reference Number	{ALPHANUM-52}	Report tracking number	4
3	Trading venue transaction identification code	{ALPHANUM-52}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	4
4	Executing entity identification code	{LEI}	Dla ETD: Broker ID, dla OTC ² : Reporting Counterparty ID;	2
5	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU	'true'- yes 'false'- no	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
6	Submitting entity identification code	{LEI}	kod LEI KDPW	
7	Buyer identification code	{LEI} {MIC} {NATIONAL_ID}'INTC'	jeśli pole Counterparty Side='B' to Reporting Counterparty ID, w przeciwnym przypadku ID of the other Counterparty; jeśli w polu ID of the other counterparty jest Clearing Member to CCP (dla LEI, dla Client Code – uzupełnienie z podsekcji MIFIR)	2
8	Country of the branch for the buyer	{COUNTRYCODE_2}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
9	Buyer - first name(s)	{ALPHANUM-140}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
10	Buyer - surname(s)	{ALPHANUM-140}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
11	Buyer - date of birth	{DATEFORMAT}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
12	Buyer decision maker code	{LEI} {NATIONAL_ID}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2

² Jako raporty OTC traktowane są raprotryraporty, w których Venue of Execution jest wypełnione wartością 'XXXX' lub „XOFF”; pozostałe traktowane są jak ETD.

Tabela 8b: Źródła danych w komunikacie tworzonym przez RT do ARM				
Nr	FIELD	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	NEW EMIR RTS Field name	SEKCJA w obecnym komunikacie trar.ins
13	Buy decision maker - First Name(s)	{ALPHANUM-140}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
14	Buy decision maker – Surname(s)	{ALPHANUM-140}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
15	Buy decision maker - Date of birth	{DATEFORMAT}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
16	Seller identification code	{LEI} {MIC} {NATIONAL_ID}'INTC'	jeśli pole Counterparty Side='S' to Reporting Counterparty ID, w przeciwnym przypadku ID of the other Counterparty; jeśli w polu ID of the other counterparty jest Clearing Member to CCP (dla LEI, dla Client Code – uzupełnienie z podsekcji MIFIR)	2
25	Transmission of order indicator	'true' 'false'	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	4
26	Transmitting firm identification code for the buyer	{LEI}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
27	Transmitting firm identification code for the seller	{LEI}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
28	Trading date time	{DATE_TIME_FORMAT}	Execution timestamp	4
29	Trading capacity	'DEAL' - Dealing on own account 'MTCH' - Matched principal 'AOTC' - Any other capacity	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	4
30	Quantity	{DECIMAL-18/17} in case the quantity is expressed as number of units {DECIMAL-18/5} in case the quantity is expressed as monetary or nominal value	Notional Amount	4
31	Quantity currency	{CURRENCYCODE_3}	Notional Currency 1	4

Tabela 8b: Źródła danych w komunikacie tworzonym przez RT do ARM				
Nr	FIELD	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	NEW EMIR RTS Field name	SEKCJA w obecnym komunikacie trar.ins
32	Derivative notional increase/decrease	'INCR' - Increase 'DECR' - Decrease	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	4
33	Price	{DECIMAL-18/13} in case the price is expressed as monetary value {DECIMAL-11/10} in case the price is expressed as percentage or yield {DECIMAL-18/17} in case the price is expressed as basis points 'PNDG' in case the price is not available 'NOAP' in case the price is not applicable	Price	4
34	Price Currency	{CURRENCYCODE_3}	Price notation	4
35	Net amount	{DECIMAL-18/5}	<i>Nie dotyczy derivatives</i>	
36	Venue	{MIC}	Venue of execution	4
37	Country of the branch membership	{COUNTRYCODE_2}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
38	Up-front payment	{DECIMAL-18/5}	jeśli pole Counterparty Side='S' to Up-front payment, w p.p. - Up-front payment	4
39	Up-front payment currency	{CURRENCYCODE_3}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	4
40	Complex trade component id	{ALPHANUM-35}	Complex trade component ID	4
41	Instrument identification code	{ISIN}	Product identification (ale tylko dla tych, w których Product identification type=ISIN)	4
42	Instrument full name	{ALPHANUM-350}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR; do rozpatrzenia czy uzupełniane z baz referencyjnych ESMA</i>	4
43	Instrument classification	{CFI_CODE}	Product classification	4

Tabela 8b: Źródła danych w komunikacie tworzonym przez RT do ARM				
Nr	FIELD	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	NEW EMIR RTS Field name	SEKCJA w obecnym komunikacie trar.ins
44	Notional currency 1	{CURRENCYCODE_3}	Notional currency 1	4
45	Notional currency 2	{CURRENCYCODE_3}	Notional currency 2	4
46	Price multiplier	{DECIMAL-18/17}	Price multiplier	4
47	Underlying instrument code	{ISIN}	Underlying identification, ale tylko wtedy gdy Underlying identification type=ISIN, dla pozostałych do uzupełnienia	4
48	Underlying index name	{INDEX} Or {ALPHANUM-25} - if the index name is not included in the {INDEX} list	Floating rate of leg 1	4
49	Term of the underlying index	{INTEGER-3}+'DAYS' - days {INTEGER-3}+'WEEK' - weeks {INTEGER-3}+'MNTH' - months {INTEGER-3}+'YEAR' - years	(Floating rate reset frequency leg 2 - multiplier) + (Floating rate reset frequency leg 2- time period)	4
50	Option type	'PUTO' - Put 'CALL' - Call 'OTHR' - where it cannot be determined whether it is a call or a put	Option type	4
51	Strike price	{DECIMAL-18/13} in case the price is expressed as monetary value {DECIMAL-11/10} in case the price is expressed as percentage or yield {DECIMAL-18/17} in case the price is expressed as basis points 'PNDG' in case the price is not available	Strike price (cap/floor rate)	4
52	Strike price currency	{CURRENCYCODE_3}	Strike price notation	4

Tabela 8b: Źródła danych w komunikacie tworzonym przez RT do ARM				
Nr	FIELD	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	NEW EMIR RTS Field name	SEKCJA w obecnym komunikacie trar.ins
53	Option exercise style	'EURO' - European 'AMER' - American 'ASIA' - Asian 'BERM' - Bermudan 'OTHR' - Any other type	Option exercise style	4
54	Maturity date	{DATEFORMAT}	Nie dotyczy derivatives	
55	Expiry date	{DATEFORMAT}	Maturity date	4
56	Delivery type	'PHYS' - Physically settled 'CASH' - Cash settled 'OPTL' - Optional for counterparty or when determined by a third party	Delivery type	4
57	Investment decision within firm	{NATIONAL_ID} - Natural persons {ALPHANUM-50} - Algorithms	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision	{COUNTRYCODE_2}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
59	Execution within firm	{NATIONAL_ID} - Natural persons {ALPHANUM-50} - Algorithms	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution	{COUNTRYCODE_2}	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	2
61	Waiver indicator	Populate one or more of the following flags: 'RFPT' - Reference price 'NLIQ' - Negotiated (liquid) 'OILQ' - Negotiated (illiquid) 'PRIC' - Negotiated (conditions) 'SIZE' - Above specified size 'ILQD' - Illiquid instrument	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	4
62	Short selling indicator	'SESH' - Short sale with no exemption 'SSEX' - Short sale with exemption	<i>Uzupełnione w sekcji MIFIR</i>	4

Tabela 8b: Źródła danych w komunikacie tworzonym przez RT do ARM				
Nr	FIELD	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	NEW EMIR RTS Field name	SEKCJA w obecnym komunikacie trar.ins
		'SELL' - No short sale 'UNDI' - Information not available		
63	OTC post-trade indicator	Populate one or more of the following flags: 'BENC' - Benchmark 'ACTX' - Agency cross 'LRGS' - Large in scale 'ILQD' - Illiquid instrument 'SIZE' - Above specified size 'CANC' - Cancellations 'AMND' - Amendments 'SDIV' - Special dividend 'RPRI' - Price improvement 'DUPL' - Duplicative 'TNCP' - Not contributing to the price discovery process 'TPAC' - Package 'XFPH' - Exchange for Physical	<i>Uzupelnione w sekcji MIFIR</i>	4
64	Commodity derivative indicator	'true' - yes 'false' - no	<i>Uzupelnione w sekcji MIFIR</i>	4
65	Securities financing transaction indicator	true - yes false- no	'No'	

9. Raportowanie w trybie Bezpośrednim

Uczestnicy usługi ARM mogą przekazywać raporty do KDPW w formie komunikatów XML do godziny wskazanej w regulaminie usługi, w dniu T+1, gdzie T-data zawarcia transakcji. KDPW wykona kontrole formalne (m.in. zgodność ze schemą XSD) oraz merytoryczne (zgodnie z opisem w rozdziale Kontrole merytoryczne raportów o transakcjach rejestrowanych w bazach usługi ARM). Komunikat zwrotny informujący o poprawności komunikatu lub o błędzie, zostanie przekazany zwrotnie uczestnikowi. Uczestnik usługi ARM otrzyma również komunikat lub komunikaty notyfikacyjne odebrane od Nadzorca. W trakcie raportowania w trybie Bezpośrednim KDPW będzie sprawdzać unikalność TRN.

10. Raportowanie delegowane

Usługa ARM oferowana przez KDPW zakłada możliwość składania raportów przez firmy pośredniczące w imieniu FI, tzw. Reprezentanta. W przypadku, gdy reprezentant będzie chciał skorzystać z opcji zasilania bazy klientów danymi, a następnie przekazywania w transakcjach identyfikatorów SHORTCODE będzie

zobowiązany do zapewnienia unikalności identyfikatorów SHORTCODE w ramach wszystkich swoich klientów, za których składa raporty.

11. Wymagane dane osobowe

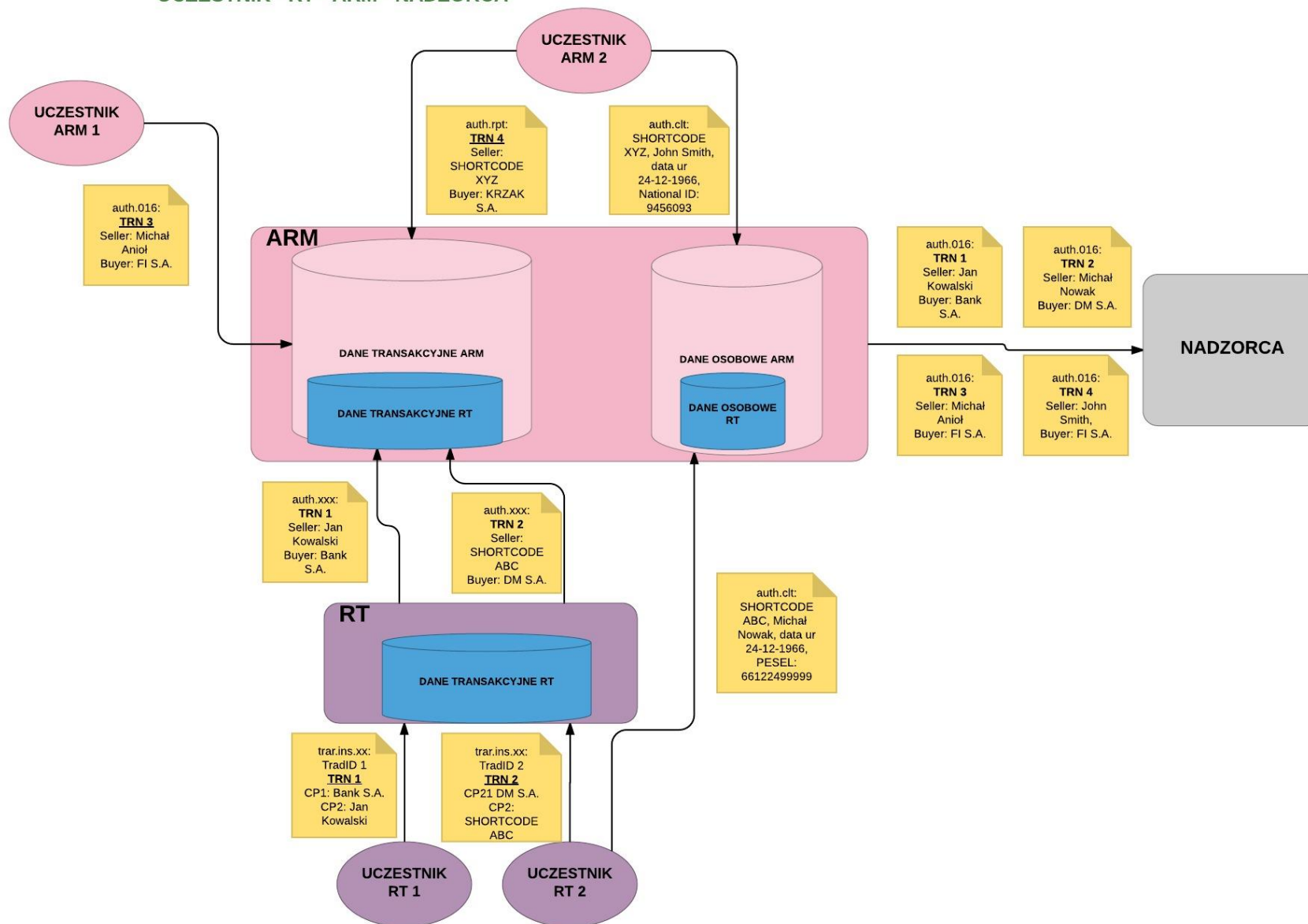
Regulacje prawne opisujące zasady raportowania w wielu miejscach zobowiązują podmiot dostarczający informacje do organów nadzoru do przekazania szeregu danych osobowych. Biorąc pod uwagę bezpieczeństwo tych danych jak również ogólnoeuropejskie ustalenia rynkowe najbardziej uniwersalnym modelem będzie stosowanie SHORTCOD-ów. W tym celu został powołany komunikat auth.clt. Nie oznacza to jednak pozbawienia uczestników usługi ARM możliwości przekazywania wymaganych danych również bezpośrednio w raportach.

Unikalność kodu SHORTCODE będzie zapewniona na poziomie każdego uczestnika raportującego. Uczestnik usługi ARM, składający raport zgodnie z MIFIR, będzie mógł złożyć go z wypełnieniem pełnych danych osobowych klientów w przesyłanym komunikacie lub wypełniając właściwe pola identyfikatorami SHORTCODE, a dane osobowe kryjące się pod danym identyfikatorem uzupełnić za pomocą komunikatu auth.clt przekazywanego bezpośrednio do KDPW. Wówczas dane te zostaną uzupełnione przez KDPW w momencie budowania raportu do Nadzorca, przy użyciu bazy danych osobowych. W ten sposób uczestnik będzie mógł przekazać dane osobowe tylko raz, a potem w razie potrzeby dokonać ich aktualizacji, zaś ARM użyje ich wielokrotnie w każdym przekazanym do Nadzorca komunikacie.

W bazie danych osobowych prowadzona będzie także baza danych klientów uczestników RT, w oparciu o SHORTOCDE.

Poniższy schemat przedstawia sposoby przekazywania i uzupełniania komunikatów o dane osobowe klientów.

PRZEKAZYWANIE DANYCH OSOBOWYCH:
UCZESTNIK - RT - ARM - NADZORCA



12. Raportowanie przez ARM do Nadzorców

Regulacje wymagają, aby raporty przekazywane do Nadzorczy przez podmiot będący ARM miały określoną strukturę komunikatów XML i były przekazywane w terminie T+1, gdzie T – data zawarcia transakcji. Zakłada się przekazywanie raportów w cyklach dziennych, w trybie 1:1 tzn. 1 raport otrzymany = 1 raport przekazany. Nie wyklucza się jednak obsługi komunikatów, w których przekazywane będą jednocześnie zbiory transakcji, tzn. 1 komunikat = 1- n transakcji.

Identyfikacja Nadzorczy, do którego zostanie przekazany raport, będzie bazowała na kodzie LEI podanym w polu 4 tabeli 2 do RTS 22: Executing entity identification code oraz kraju siedziby podmiotu podanej w bazie GLEIF.

Lista komunikatów związanych z przekazywaniem raportów do Nadzorczy obejmuje:

- raport - auth.016.001.01,
- status raportu – auth.031.001.01,
- nagłówek BAH -head.001.0.001.01,
- nagłówek pliku – head.003.001.01.

Dla otrzymanych poprawnych raportów, KDPW będzie przekazywał zwrotnie do uczestnika usługi ARM kopię przekazanego raportu - komunikat auth.016 w tym samym momencie, w którym raport przekazywany jest do Nadzorczy.

Do FI przekazywany będzie niezwłocznie każdy (także powtórny) komunikat statusowy otrzymywany od Nadzorczy. Według obecnie opublikowanych informacji Nadzorca ma czas T+7 na procesowanie i wysyłanie statusów otrzymanych komunikatów. Zakłada się, że struktura komunikatu statusowego będzie zgodna ze schematem komunikatu auth.031. (patrz także załącznik V: DRAFT5auth.031.001.01_ESMAUG_NationalReporting_1.0.0).

W poniższej tabeli przedstawiono listę stosowanych przez Nadzorców kodów statusu i kodów błędów po walidacji komunikatu (zbioru raportów/transakcji).

Tabela 12a: Lista stosowanych przez Nadzorców kodów statusu i kodów błędu po walidacji komunikatu

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. Wydaje się, że to można wyeliminować poprzez stosowanie jedynie pojedynczych komunikatów. Ostateczna decyzja po ustaleniach z KNF
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 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 błędu 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 błędu 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.

W poniższej tabeli przedstawiono listę stosowanych kodów statusu i kodów błędu dotyczących walidacji pojedynczego raportu/transakcji.

Tabela 12b: Listę stosowanych przez nadzorę kodów statusu i kodów błędu dotyczących walidacji pojedynczego raportu/transakcji			
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 przetworzenie.	Kod statusu stosowany w przypadku, gdy raport o transakcji nie może być zwalidowany z powodu braku danych referencyjnych instrumentu. W złożonym elemencie RcrdSts należy podać kod błędu CON-411 (oczekiwanie na walidację instrumentu), CON-471 (oczekiwanie na walidację instrumentu bazowego). W przypadku zastosowania tego statusu, transakcja powinna zostać zgłoszona jako odrzucona lub przyjęta w jednym z kolejnych komunikatów zwrotnych wystawnych maksymalnie
WARN	Ostrzeżenie	Transakcję przyjęto z ostrzeżeniem.	Nie stosowany.
RJCT	Odrzucono	Transakcję odrzucono.	Kod statusu stosowany w przypadku błędnego raportu o transakcji. Kody błędu 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.

Więcej szczegółów na temat raportowania do Nadzorczy i przekazywania danych pomiędzy Nadzorcami znajduje się w załączniku IV: Technical Reporting Instructions - MiFIR Transaction Reporting.

13. Proste przykłady raportowania

13.1. Raportowanie transakcji z rynków zorganizowanych

Przykład 1. Transakcja na rachunek własny (zlecenie klienta)

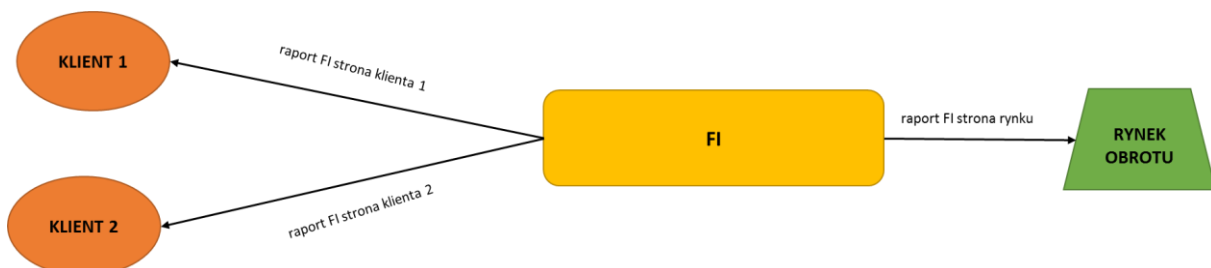


FI (FI SA) otrzymuje zlecenie od klienta (Firmy Notes SA) na zakup instrumentów na Rynku obrotu R. FI SA realizuje zlecenie na rachunek własny (po cenie 0.352 GBP i odsprzedaje instrument Firmie Notes SA po cenie 0.370 GBP).

FI SA zobowiązana jest do przesłania 2 następujących raportów do Nadzorczy (zgodnie z powyższym schematem).

Tabela 13a: Przykład 1			
Nr pola (tabela 2 RTS 22)	Pole	Wartość w raporcie 1 (strona rynku)	Wartość w raporcie 2 (strona klienta)
4	Executing entity identification code	{LEI} Firmy FI SA	{LEI} Firmy FI SA
7	Buyer identification code	{LEI} Firmy FI SA	{LEI} Firmy Notes SA
16	Seller identification code	{LEI} CCP obsługującego Rynek R	{LEI} Firmy FI SA
29	Trading capacity	'DEAL'	'DEAL'
33	Price	'0.352'	'0.370'
36	Venue	MIC segmentu Rynku R	'XOFF'

Przykład 2. Transakcja realizująca kilka zleceń klientów



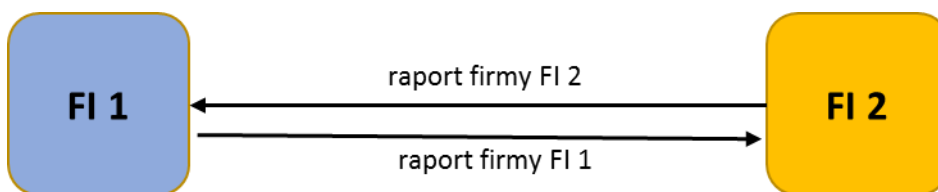
Firma FI otrzymuje zlecenia od Klienta 1 i Klienta 2 na zakup tego samego instrumentu (wolumen 100 dla Klienta 1 i 200 dla Klienta 2) na Rynku R. Firma agreguje zlecenia i zawiera transakcje na rynku R (w dniu

1 lipca 2018 o godzinie 10:00) – wolumen 300 po cenie 25,54 EUR. Zakupione instrumenty są lokowane na konta klientów 15 minut później. Firma działa na rachunek własny.

Firma FI zobowiązana jest przesłać 3 raporty, zgodnie z powyższym schematem.

Nr pola (tabela 2 RTS 22)	Pole	Wartość w raporcie FI – strona Rynku	Wartość w raporcie FI – strona Klienta 1	Wartość w raporcie FI – strona Klienta 2
4	Executing entity identification code	{LEI} firmy FI	{LEI} firmy FI	{LEI} firmy FI
7	Buyer identification code	{LEI} CCP for obsługującego Rynek R	{LEI} firmy FI	{LEI} firmy FI
16	Seller identification code	{LEI} firmy FI	{LEI} Klienta 1	{LEI} Klienta 2
28	Trading date time	'2018-07-01T10:00:00Z'	'2018-07-01T10:15:00Z'	'2018-07-01T10:15:00Z'
29	Trading capacity	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Quantity	'300'	'100'	'200'
33	Price	'25.54'	'25.54'	'25.54'
36	Venue	{MIC} segment Rynku R	'XOFF'	'XOFF'

13.2. Raportowanie transakcji z rynku OTC



Firma FI 1 zawiera transakcję na akcjach z firma FI 2 poza rynkiem obrotu. Obie firmy działają na rachunek własny. Transakcję kwalifikuje się jako 'duża w skali'. Jako transakcja OTC wymaga raportowania wartości w polu 63 - OTC post-trade indicator.

Obie firmy inwestycyjne zobowiązane są do przekazania raportów zgodnie z powyższym schematem.

Tabela 13c: Przykład 3			
Nr pola (tabela 2 RTS 22)	Field	Wartość w raporcie FI1	Wartość w raporcie FI2
4	Executing entity identification code	{LEI} firmy FI1	{LEI} firmy FI2
29	Trading capacity	'DEAL'	'DEAL'
36	Venue	'XOFF'	'XOFF'
63	OTC post-trade indicator	'LRGS'	'LRGS'

14. Opłaty

Obecny model usługi proponowanej przez KDPW przewiduje wprowadzenie dwóch rodzajów opłat:

- za uczestnictwo w systemie - z jednoczesnym uwzględnieniem relacji FI – KDPW związanej z innymi usługami obniżającej wysokość tej opłaty
- za przekazany raport

Jednocześnie zakłada się, że opłaty nie przekroczą 0,05zł za przekazany przez ARM do Nadzorcy raport a opłata za uczestnictwo może być zróżnicowana w zależności od zakresu uprawnień.

15. Załączniki

Załącznik I: Zasady walidacji

Załącznik II: DRAFT15 auth.016.001.01_ESMAUG_Reporting_1.0.2

Załącznik III: Komunikat wzbogacania o dane posttransakcyjne do transakcji z GPW – auth.enr

Załącznik IV: Technical Reporting Instructions - MiFIR Transaction Reporting

Załącznik V: DRAFT5 auth.031.001.01_ESMAUG_NationalReporting_1.0.0

Załącznik VI: RTS 22 - COMMISSION DELEGATED REGULATION (EU) 2017/590 of 28 July 2016 supplementing Regulation (EU) No 600/2014 of the European Parliament and of the Council with regard to regulatory technical standards for the reporting of transactions to competent authorities

Załącznik VII: Komunikat z danymi osobowymi – auth.clt

Załącznik VIII: Komunikat auth.rpt

Załącznik IX: ARM kwestie do konsultacji

Załącznik X: auth.stc – komunikat statusowy do komunikatu auth.clt.