

RT/ZW/ 20 /2019

Warszawa, 28 stycznia 2019 r.

Uczestnicy ARM

Szanowni Państwo,

w związku ze zmianami ogłoszonymi przez ESMA w obszarze reguł walidacyjnych określonych dla pół raportowanych zgodnie z RTS 22 do Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady nr 600/2014 (MIFIR) oraz schem komunikatów auth.016.001.01 i auth.031.001.01 w niniejszym piśmie przedstawiamy Państwu modyfikacje, jakie zostaną wprowadzone w lutym 2019 r. w usłudze ARM. Aktualnie nie jest jeszcze znana konkretna data wdrożenia powyższych zmian, jednak powinno to nastąpić w drugiej połowie lutego 2019 r.

Dokładna informacja o terminie wdrożenia zostanie ogłoszona w najbliższym czasie przez ESMA, o czym niezwłocznie Państwa poinformujemy.

Zmiany walidacyjne w systemie ARM

Po weryfikacji ogłoszonych zmian dokonaliśmy korekt w obszarze sześciu reguł walidacyjnych. Poniżej umieszczamy dokładną informację na temat nowego sposobu funkcjonowania zmodyfikowanych kontroli. Zmiany w obszarze poszczególnych kontroli zostały podkreślone.

- Reguła R029

Badanie aktywności kodu LEI firmy wykonującej w bazie GLEIF na dzień zawarcia transakcji (gdy wskaźnik FI równy 'true') - kod musi mieć status "Issued", "Pending transfer" lub "Pending archival". Jeżeli na dzień zawarcia transakcji kod LEI ma status „Lapsed”, wówczas wykonywana jest dodatkowa kontrola na dzień przekazania transakcji.

Kod błędu: CON-040

- Reguła R068

Badanie obowiązkowości występowania kodu kraju oddziału uczestnictwa w raporcie, gdy transakcja jest zawarta na EOG lub na rynku poza UE. Dodatkowo ESMA dopuszcza brak

raportowania kodu kraju oddziału dla transakcji, gdzie kod rynku wskazuje, że transakcja jest wykonywana za pośrednictwem podmiotu Systematycznie Internalizującego transakcje.

Kod błędu: CON-370

- Reguła R193

Badanie występowania nazwy indeksu bazowego, gdy CFI wskazane w raporcie spełnia kryteria: 'O..I..', 'O..N..', 'FFI...', 'FFN...', 'RWI...'.

Kod błędu: CON-480

- Reguła R198

Badanie prawidłowego typu dostawy w zależności od typu instrumentu wynikającego z CFI wskazanego w raporcie. Poszerzenie kontroli poprzez dodanie kodu CFI HT***C, dla którego typ dostawy musi być wypełniony wartością 'CASH': OC***C, OP***C, FF***C, FC***C, SR***C, ST***C, SE***C, SC***C, SM***C, HR***C, HT***C, HE***C, HC***C, HF***C, HM***C, JE***C, JF***C, JC***C, JR***C, JT***C, LL***C.

Kod błędu: CON-560

- Reguła S010

Reguła sprawdzająca brak wystąpienia wartości w polu Kod identyfikacyjny transakcji nadany przez system obrotu w przypadku gdy pole kod rynku (miejsce zawarcia transakcji) jest wypełnione kodem MIC odpowiadającym systemowi obrotu spoza EOG lub 'XXXX' lub 'XOFF'. Kod identyfikacyjny transakcji nadany przez system obrotu nie może być raportowany również dla transakcji, gdzie kod rynku wskazuje, że transakcja jest wykonywana za pośrednictwem podmiotu Systematycznie Internalizującego transakcje.

Kod błędu: CON-030

- Reguła S136

Klasyfikacja instrumentu powinna być zgodna z rodzajem opcji z uwagi na sposób wykonania opcji – OptnExrcStyle :

1. Gdy sposób wykonania = 'EURO', należy zastosować kod CFI z następującej listy: 'O.E...', 'H..A..', 'H..D..', 'H..G..', 'RW...E', 'RF...E';
2. Gdy sposób wykonania = 'AMER', należy zastosować kod CFI z następującej listy: 'O.A...', 'H..B..', 'H..E..', 'H..H..', 'RW...A', 'RF...A';

3. Gdy sposób wykonania = 'BERM', należy zastosować kod CFI z następującej listy: 'O.B...', 'H..C..', 'H..F..', 'H..I..', 'RW...B', 'RF...B'.

Kod błędu: CON-431

W związku z powołaniem nowych walidacji, po ogłoszeniu przez ESMA daty wdrożenia zmiany, zaktualizowany zostanie dokument - *Kontrole merytoryczne i formalne komunikatów w systemie ARM* zamieszczony na stronie KDPW.

Wdrożenie schem

Kolejną zmianą ogłoszoną przez ESMA jest zastąpienie obecnych schem (z oznaczeniem „Draft”) komunikatów auth.016.001.01 oraz auth.031.001.01 nowymi schemami opublikowanymi przez europejskiego nadzorcę. Różnice pomiędzy schemami są kosmetyczne, tj. niewielkie rozszerzenie zakresu dopuszczalnych znaków dla elementów FrstNm i Nm w auth.016.001.01 oraz zmiana nazwy kilku elementów w auth.031.001.01. W związku z tym, że od momentu wdrożenia nie zaobserwowaliśmy komunikatów, w przypadku których zbyt mały zakres typu danych dla pól FrstNm oraz Nm powodowałby odrzucenie transakcji, podjęliśmy decyzję, że schemy komunikatów własnych Kdpw_Arm nie ulegną zmianie (auth.rpt.001.01, auth.clt.001.01, auth.enr.001.01, auth.str.001.01, auth.stc.001.01, auth.ste.001.01). Ewentualna aktualizacja zostanie przeprowadzona w przyszłości w razie konieczności przygotowania nowych wersji komunikatów Kdpw_Arm. Ze strony użytkownika kluczowe znaczenie, wynikające z wdrożenia nowych schem, może mieć komunikat auth.016.001.01, który jest wysyłany jako komunikat notyfikacyjny. Uprzejmie prosimy o dokonanie analizy swoich systemów pod kątem przyjmowania kopii komunikatów wysyłanych do nadzorcy, które po wdrożeniu schem będą zawierać nowy nagłówek.

Terminy

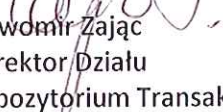
- Opisane powyżej zmiany zaczną obowiązywać najprawdopodobniej w drugiej połowie lutego 2019 r., zgodnie z terminem wdrożenia, który zostanie ogłoszony przez ESMA. W środowisku TSTB ARM zmiany zostaną udostępnione od początku lutego 2019 r. O wszelkich terminach wdrażania powyższych zmian będą Państwo na bieżąco przez nas informowani.

- Zachęcamy Państwa do wprowadzenia możliwie szybkiej zmiany w procesach związanych z raportowaniem mającej na celu zapewnienie przekazywania prawidłowych danych w zakresie opisanych przypadków.

Uwagi i komentarze

Uprzejmie prosimy o zapoznanie się z załączonym materiałem i przekazanie ewentualnych pytań oraz wątpliwości. Wszelkie uwagi związane z usługą ARM prosimy przesyłać pod adres: arm@kdpw.pl lub kierować pod numer telefonu 22 537 94 63.

Z poważaniem,


Sławomir Zając
Dyrektor Działu
Repozytorium Transakcji

Załączniki

Nowe schemy dla komunikatów auth.016.001.01 oraz auth.031.001.01.

Zaktualizowany plik xlsx zawierający Reguły walidacyjne opublikowane przez ESMA.