

RT /ZW/ 319 /2018

Warszawa, 18 września 2018 r.

Uczestnicy ARM**Dot. usługi ARM**

W związku z dbałością o jakość danych raportowanych na podstawie RTS 22 do Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady nr 600/2014 (MIFIR) oraz w związku z rozwojem usługi ARM przedstawiamy Państwu zakres zmian jaki zostanie zaimplementowany w serwisie ARM w najbliższych miesiącach. Od strony technicznej wdrożone zostaną nowe walidacje oraz udoskonalone zostanie raportowanie w tzw. trybie RT w zakresie usuwania raportów za pośrednictwem AT= E (Error). Ponadto chcemy zwrócić Państwa szczególną uwagę na kilka istotnych kwestii związanych z jakością przekazywanych szczegółów transakcji.

Nowe walidacje w systemie ARM

Na podstawie analizy jakości danych przekazywanych do ARM w ramach raportowania zgodnego z RTS 22 okazało się, iż konieczne jest wdrożenie rozwiązań zapewniających występowanie identyfikatora transakcji nadawanego przez system obrotu oraz badanie jego prawidłowości. W konsekwencji zwracamy się z prośbą o wypełnianie pola [TradPlcMtchgID](#) w przypadku przekazywania szczegółów transakcji zawieranych w systemach obrotu. Dodatkowo, w obszarze przekazywania szczegółów transakcji zawartych w systemach obrotu zlokalizowanych w polskiej jurysdykcji, zostaną wprowadzone nowe kontrole merytoryczne zapewniające obowiązkowe wypełnienia pola [TradPlcMtchgID](#) w specyficznych przypadkach oraz kontrolujące poprawność zamieszczanego identyfikatora. Poniżej opis nowych walidacji.

- Reguła K019.

W przypadku transakcji zawieranych na rynku oznaczonym kodem MIC, do którego przypisany jest kod kraju 'PL' i jednocześnie innym niż XOFF lub XXXX pole [TradPlcMtchgID](#) musi być wypełnione.

Kod błędu: KON-019 - Brak wypełnienia identyfikatora transakcji nadanego przez rynek.

- Reguła K020

w przypadku transakcji zawieranych na rynkach organizowanych przez GPW (weryfikacja na poziomie kodu MIC podawanego w polu TradVn) sprawdzeniu podlegać będą wartości zamieszczane w identyfikatorze TradPlcMtchgID. W ramach badania poprawności identyfikatorów podawanych w transakcjach zawartych na GPW kontrolowane będą:

- MIC (pierwsze 4 znaki identyfikatora) – sprawdzenie czy kod MIC z identyfikatora TradPlcMtchgID jest zgodny z kodem podanym w polu TradVn,
- InstrumentID (znaki od 5 do 16 identyfikatora) – sprawdzanie czy identyfikator ten jest zgodny z bazą kodów ISIN / pseudo-ISIN funkcjonujących w systemie GPW,
- nrTransakcji (znaki od 17) – sprawdzanie czy wśród użytych znaków występują wyłącznie cyfry.

Kod błędu: KON-020 - Nieprawidłowa wartość identyfikatora transakcji z systemu obrotu.

W związku z powołaniem nowych walidacji zaktualizowany został dokument - *Kontrole merytoryczne i formalne komunikatów w systemie ARM* zamieszczony na stronach KDPW.

Optymalizacja trybu RT

W wyniku zdobytych doświadczeń, a także z uwagi na dotychczasowe ograniczenia występujące w ramach trybu RT (tj. jednoczesnego raportowania za pośrednictwem komunikatu trar.ins pod dwoma reżimami raportowymi – EMIR i MIFIR) wdrożone zostaną następujące zmiany formalne (na poziomie komunikatu xml) i merytoryczne (na poziomie walidacji).

- Zmiana struktury komunikatu trar.ins.001.04 (nowa wersja komunikatu):
 - Dodanie pola ReportTrackingNumber (RptTrckgNb) do sekcji Error. Jest to identyfikator służący do unikalnej identyfikacji szczegółów transakcji przekazywanych do ARM.
 - Zmiana formatu pola ReportTrackingNumber (RptTrckgNb) we wszystkich sekcjach na zgodny z formatem pola Identyfikacja transakcji (TxId) z komunikatu auth.rpt.001.01, tj. ESMA_AlphanumericMax52_Pattern.
 - Wprowadzenie obowiązkowości sekcji Additional Attributes (AddlAttrbts) – sekcja znajduje się w części dedykowanej raportowaniu MIFIR.
 - Zmiana formatów sekcji Person/FrstNm i Nm na zgodny z komunikatem auth.rpt.

- Nowe kontrole merytoryczne:
 - Jeżeli Regulation Indicator = B lub M, to pole RptTrckgNb musi być wypełnione (dotyczy rodzajów zmian AT = N, E i R) oraz na potrzeby poprawnego generowania komunikatu auth.rpt.001.001.01 nie może zawierać znaków specjalnych (co jest dopuszczalne zgodnie z formatem EMIR). W przypadku wstawienia znaków specjalnych w polu RptTrckgNb, komunikat zostaje odrzucony z podaniem przyczyny błędu.
 - Jeżeli Regulation Indicator = B lub M, to pola Counterparty Side w sekcjach Counterparty Specific Data i MiFIR muszą zawierać tę samą wartość (B lub S). W przeciwnym razie, komunikat jest odrzucany z podaniem przyczyny błędu.
 - Jeżeli Regulation Indicator = B lub M oraz Other Counterparty (OthrCtrPty) jest oznaczony kodem klienta (tzn. tag ClntId jest wypełniony) zastosowane są następujące kontrole:
 - jeżeli Counterparty Side = B, to sekcja Seller/Account Owner/Id musi być wypełniona,
 - jeżeli Counterparty Side = S, to sekcja Buyer/Account Owner/Id musi być wypełniona.

Informujemy również, że został opracowany nowy dokument składający się na specyfikację systemu ARM w zakresie raportowania z wykorzystaniem Trybu RT – *Materiał opisujący proces raportowania MiFIR za pośrednictwem ARM z wykorzystaniem systemu RT.*

Jakość danych przekazywanych w szczegółach transakcji

Korzystając z okazji pragniemy zwrócić Państwa uwagę na kwestie, które zaobserwowaliśmy w okresie od stycznia br. do dnia dzisiejszego, mające wpływ na jakość raportowanych danych.

- Dane osób fizycznych, tj. w szczególności prawidłowe raportowanie imion i nazwisk we właściwych tagach komunikatu XML:
 - FrstNm – imię,
 - Nm – nazwisko.
- Wartości stempli czasowych zawieranych transakcji, ze szczególnym uwzględnieniem transakcji zawieranych na rynku giełdowym. Wartości stempli czasowych powinny być w takich przypadkach zgodne z wartościami wyznaczonymi przez system obrotu.

Terminy

- Zmiany opisane w punktach: Nowe walidacje w systemie ARM i Optymalizacja trybu RT będą obowiązywać w systemach produkcyjnych od 5 listopada 2018r.
- Powyższe zmiany zostaną udostępnione w środowisku TSTB ARM i KDPW_TR w dniu 10 października 2018r.
- W przypadku pozostałych zagadnień zachęcamy Państwa do wprowadzenia możliwie szybkiej zmiany w procesach związanych z raportowaniem mających 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.

Załączniki

Kontrole merytoryczne i formalne komunikatów w systemie ARM zamieszczony na stronach KDPW.

Materiał opisujący proces raportowania MIFIR za pośrednictwem ARM z wykorzystaniem systemu RT.

Z poważaniem

Sławomir Zając

Dyrektor Działu
Repozytorium Transakcji