

Warszawa, 15 września 2017 r.

Uczestnicy KDPW
Uczestnicy Repozytorium Transakcji
Uczestnicy KDPW_CCP
Podmioty zainteresowane

Dot. usługi ARM

W nawiązaniu do dotychczasowej korespondencji, w szczególności do pisma z dnia 8 maja 2017 r. (sygnatura RT/ZW/182/2017) mamy przyjemność przekazać Państwu szczegółowe informacje dotyczące aktualizacji specyfikacji oraz rozszerzenia dokumentacji.

Usprawnienie usługi

W odpowiedzi na zgłoszenia odebrane od zainteresowanych podmiotów oraz w wyniku pogłębionych, wewnętrznych analiz została opracowana modyfikacja tzw. trybu bezpośredniego raportowania do KDPW_ARM. Modyfikacja dotyczy przepływu komunikatów między ARM a Uczestnikami. Zmiany opisane w dalszej części niniejszego pisma w szczególności umożliwią:

- jednoznaczne rozróżnienie statusów ARM od statusów Nadzorcy.
- amortyzowanie przyszłych zmian w Regulacjach, w szczególności w standardach technicznych, na poziomie usługi ARM. Dla przykładu: takiego zarządzania interfejsem ARM – Uczestnik, aby zakres zmian po stronie uczestników był możliwie minimalny.
- usprawnienie przepływu komunikatów polegające na wyeliminowaniu sekcji *status komunikatu*. Sekcja ta w przekonaniu KDPW nie wnosi żadnych korzyści do obsługi, a w niektórych przypadkach stanowi barierę w optymalnym generowaniu komunikatów.
- dostosowanie KDPW_ARM do raportowania do dowolnego Nadzorcy.

Szczegółowy wykaz zmian i modyfikacji

- składanie raportów w trybie bezpośrednim będzie realizowane wyłącznie za pośrednictwem komunikatu auth.rpt.001.01.

- powołanie nowego komunikatu statusowego auth.str.001.01, który zastąpi w ramach zgłaszania transakcji komunikat statusowy auth.031. W komunikacie auth.str w stosunku do komunikatu auth.031 wprowadzono następujące zmiany:
 - usunięto sekcję *status komunikatu*, tym samym usunięte zostaną statusy do komunikatu.
 - powołano odrębne sekcje dla odpowiedzi na zgłoszenie/usunięcie transakcji. Odseparowane sekcje umożliwią rozróżnienie po stronie uczestnika, czy dany komunikat statusowy jest związany ze zgłoszeniem transakcji, czy też z jej usunięciem.
 - zmieniono format pola OrgnlRcrdId na Max52Txt, czyli format zgodny z komunikatem wejściowym.
 - rozszerzono słownik kodów statusów rekordu/transakcji o statusy ARM. W efekcie wykaz statusów będzie następujący:
 - Statusy Nadzorcy:
 - ACPT – Transakcja została przyjęta.
 - ACPD – Przyjęto po oczekiwaniu. Transakcja oczekująca, w poprzednim raporcie została przyjęta.
 - PDNG – Transakcja oczekuje na przetwarzanie.
 - WARN – Transakcje przyjęto z ostrzeżeniem.
 - RJCT – Transakcje odrzucono.
 - RJPD – Odrzucono po oczekiwaniu.
 - Statusy KDPW_ARM:
 - ARWR – Zaakceptowano z ostrzeżeniem. Status informujący o braku występowania danego instrumentu na liście FIRDS.
 - ARPD – Oczekuje na przetworzenie. Status stosowany przy obsłudze usunięcia transakcji.
 - ARAC – Przyjęto do ARM.
 - ARRJ – Odrzucone przez ARM.
 - ARCL – Usunięta z ARM. Status wysyłany, gdy transakcja zmienia status na usunięta z baz ARM.
 - ARRW – Ostrzeżenie o naprawie. Status wysyłany w trybie uproszczonym w przypadku gdy w momencie odebrania transakcji z rynku w ARM nie ma danych osobowych.

- modyfikacja komunikatu auth.stc.001.01.
 - usunięcie sekcji status komunikatu – **MsgSts** – tym samym usunięte zostały statusy do komunikatów.
 - zmiana dotychczasowych statusów rekordu na statusy własne ARM i ograniczenie liczby statusów do następujących:
 - ARAC – Przyjęto do ARM.
 - ARRJ – Odrzucone przez ARM.
 - ARPD – Oczekuje na przetworzenie. W chwili uruchomienia usługi brak zastosowania.

- modyfikacja komunikatu auth.ste.001.01
 - ujednoczenie nazwy tag-u służącego do identyfikacji transakcji do nazw stosowanych w pozostałych komunikatach statusowych - zmiana nazwy z **Txid** na **OrgnlRcrdId**;
 - zmiana dotychczasowych statusów rekordu/transakcji na statusy własne ARM i ograniczenie liczby statusów do następujących:
 - ARAC – Przyjęto do ARM.
 - ARRJ – Odrzucone przez ARM.
 - ARPD – Oczekuje na przetworzenie. W chwili uruchomienia usługi brak zastosowania.

Uzupełnienie specyfikacji

Wraz ze zmianami w komunikatach został zmodyfikowany dokument *Materiał informacyjny dotyczący systemu do obsługi zatwierdzonego mechanizmu sprawozdawczego*.

Dodatkowo został powołany nowy dokument *Materiał informacyjny dotyczący przepływu komunikatów w systemie KDPW_ARM*. Dokument ten w szczególności określa:

- Pełny wykaz komunikatów dziedzinowych.
- Definiuje pojęcie pliku.
- Określa zasady budowania relacji między komunikatami przesyłanymi przez Uczestników do ARM a komunikatami wychodzącymi z ARM do Uczestników.
- Definiuje unikalność identyfikatora transakcji giełdowych – dotyczy transakcji GPW.
- Obrazuje przepływy komunikatów we wszystkich trzech trybach.
- Opisuje zasady przetwarzania komunikatu auth.clt.001.01 oraz auth.enr.001.01.

Zamknięcie konsultacji i kwestii otwartych

Jednocześnie pragniemy Państwu bardzo podziękować za udział w konsultacjach w zakresie wykorzystania w mechanizmie raportowania instrukcji rozrachunkowych i powołania komunikatu dedykowanego do alokacji transakcji rynkowych. W wyniku pozyskanych informacji oraz po przeprowadzeniu analizy zakresu zmian i napiętego harmonogramu podjęto decyzję, iż z chwilą uruchomienia usługi KDPW nie będzie:

- udostępniał trybu polegającego na budowaniu raportów o transakcjach na podstawie instrukcji rozrachowywanych w KDPW;
- powoływał dedykowanego komunikatu służącego do przekazania raportu rozszerzającego zagregowane transakcje rynkowe.

Jednocześnie miło nam poinformować, iż konsultacje, o których informowaliśmy w poprzednim piśmie, dotyczące rozszerzenia trybu uproszczonego (rynkowego) o transakcje zawierane na BondSpot zakończyły się porozumieniem. Tym samym w ramach tego trybu KDPW będzie budował transakcje również z BondSpot.

Uwagi i komentarze

Uprzejmie prosimy o zapoznanie się z załączonym materiałem oraz o przekazanie ewentualnych pytań. Wszelkie uwagi związane z usługą prosimy przysyłać pod adres: arm@kdpw.pl.

Jednocześnie informujemy, że w drugiej połowie października w siedzibie KDPW SA odbędzie się spotkanie dedykowane testom usługi KDPW_ARM.

Wszystkie komunikaty i materiały, do których odwołuje się niniejsze pismo zostaną opublikowane na stronie internetowej KDPW w sekcji ARM.

Z poważaniem


Sławomir Zajac

Dyrektor Działu Repozytorium Transakcji

Kilka minut temu