

Warszawa, 28 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 15 września 2017r. (sygnatura RT/ZW/360/2017), mamy przyjemność przekazać Państwu szczegółowe informacje dotyczące nowych materiałów pomocniczych oraz uzupełnieniu już istniejących. Przede wszystkim zwracamy Państwa uwagę na wprowadzenie zapisów zwiększających atrakcyjność raportowania w tzw. trybie uproszczonym.

Optymalizacja trybu uproszczonego

- Trybem uproszczonym zostaną objęte transakcje z BondSpot i Treasury BondSpot.
- Budowanie raportów z Treasury BondSpot będzie możliwe bez dostarczania komunikatu wzbogacającego auth.enr.001.01. KDPW_ARM będzie budował raport do Nadzorczy wyłącznie na podstawie danych otrzymanych bezpośrednio z rynku, uzupełnionych przez Uczestnika KDPW_ARM o dane osobowe za pośrednictwem komunikatu auth.clt.001.01.
- Uproszczenie komunikatu auth.enr.001.01 w przypadku transakcji z rynku regulowanego. Redukcja struktury komunikatu wzbogacającego wynika z faktu, iż identyfikatory SHORTCODE firm inwestycyjnych przekazujących zlecenie na rynek w imieniu nabywcy / zbywcy (tzw. transmitting firm) będzie można przekazać w trakcie zawierania transakcji na GPW/BondSpot. Dane te znajdują się w plikach posttransakcyjnych odbieranych przez KDPW_ARM bezpośrednio z rynku. Tym samym znaczącej redukcji uległa struktura komunikatu wzbogacającego oraz ewentualna potrzeba jego zastosowania. W efekcie większa liczba raportów będzie budowana przez KDPW_ARM i składana do Nadzorczy bez dodatkowej aktywności firmy inwestycyjnej.
- Wprowadzone zostały również dodatkowe reguły budowania komunikatów z raportem do Nadzorczy na podstawie danych rynkowych w zakresie pól „podejmujący decyzję za kupującego/sprzedającego”. Reguły te umożliwią uzupełnianie pól występujących

w komunikacie auth.enr.001.01 bez konieczności jego stosowania. Reguły wyznaczania poszczególnych wartości zostały szczegółowo opisane w zaktualizowanych materiałach informacyjnych. Zmiany te również ograniczają liczbę przypadków, w których niezbędne będzie dostanie komunikatu wzbogacającego.

Dodatkowe materiały

Z uwagi na opisane powyżej zmiany w trybie uproszczonym oraz w odpowiedzi na zgłoszenia i zapotrzebowanie płynące ze strony podmiotów zainteresowanych usługą KDPW_ARM wzbogacone zostały materiały informacyjne opisujące usługę. Zmiany polegają na powołaniu nowego dokumentu oraz uzupełnieniu już istniejących.

- Powołany został nowy dokument *Materiał informacyjny – schematy przepływów statusów w systemie KDPW_ARM*. Dokument obrazuje cykl życia transakcji oraz zmiany statusów raportów wzbogacających i raportu z danymi osobowymi.
- Uzupełniony został dokument *Materiał informacyjny dotyczący przepływu komunikatów w systemie KDPW_ARM*.
- Uzupełniony został dokument *Materiał informacyjny dotyczący systemu do obsługi zatwierdzonego mechanizmu sprawozdawczego KDPW_ARM*.

Informacje o zakresie modyfikacji już istniejących dokumentów znajdują się w historii zmian zamieszczonej w poszczególnych materiałach.

Zmiany w komunikatach

W związku z zapotrzebowaniem zgłaszanym przez zainteresowane podmioty oraz w związku z uproszczeniem komunikatu wzbogacającego wprowadziliśmy zmiany w poniższych komunikatach. Polegają one na zredukowaniu struktury i na zoptymalizowaniu sposobów przekazywania identyfikatorów firm inwestycyjnych.

Komunikat auth.rpt.001.01.

- dodanie możliwości podania czteroznakowego kodu uczestnika zamiast LEI (na zasadzie alternatywnego wyboru) w sekcjach:
 - 1.1.2 ExctgPty,
 - 1.1.4 SubmitgPty,
- dodanie możliwości podania SHORTCODE zamiast LEI (na zasadzie alternatywnego wyboru) w sekcjach:

- 1.1.7.2 TrnsmtgBuyr,
- 1.1.7.3 TrnsmtgSellr.

➤ Komunikat auth.rpt.001.01.

Usunięcie dotychczasowej sekcji 1.1.4 (OrdrTrnsmss).

➤ Komunikat auth.str.001.01.

Dodanie kodu statusu własnego ARCC – Żądanie usunięcia zaakceptowane przez ARM.

Szczegóły dotyczące zastosowania tego statusu znajdują się w nowym dokumencie *Materiał informacyjny – schematy przepływów statusów w systemie KDPW_ARM*.

Uwagi i komentarze

Uprzejmie prosimy o zapoznanie się z załączonym materiałem oraz o przekazanie ewentualnych pytań.

Wszelkie uwagi związane z usługą prosimy przesyłać pod adres: arm@kdpw.pl.

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

Z poważaniem

Sławomir Zając

Dyrektor Działu

Repozytorium Transakcji