

EMIR II: Zasady raportowania do KDPW_TR po wejściu w życie nowych standardów technicznych

Dział Repozytorium Transakcji KDPW

- ❑ **Informacje ogólne**
- ❑ **Zmiany w procesie raportowania: identyfikatory, funkcjonalności, walidacje**
 - ✓ Zasady migracji danych – mapowanie pól
 - ✓ Zmiany w komunikatach
 - ✓ Procesowanie raportów
 - ✓ Identyfikacja – kody LEI
 - ✓ Identyfikacja – kody ISIN
 - ✓ Nowe pola, zasady walidacji
- ❑ **Raportowanie transakcji podlegających obowiązkowi raportowemu EMIR i MiFIR**
- ❑ **Nowe typy uczestnictwa**
 - ✓ TUR
 - ✓ IUR
- ❑ **Harmonogram**

Informacje ogólne

Nowe standardy techniczne EMIR – opublikowane w Dzienniku Urzędowym UE w dniu 21 stycznia 2017, **obowiązujące od 1 listopada 2017 r.:**

- ❑ **Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/104 z dnia 19 października 2016 r. zmieniające rozporządzenie delegowane (UE) nr 148/2013** uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających minimalny poziom szczegółowości informacji podlegających zgłoszeniu repozytoriom.
- ❑ **Rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) 2017/105 z dnia 19 października 2016 r. zmieniające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 1247/2012** ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji.
- ❑ **Nowa tabela walidacyjna** dot. obligatoryjności poszczególnych pól oraz zasad ich wypełniania (na poziomie transakcji i pozycji dla poszczególnych rodzajów zmian) – publikacja ESMA: kwiecień 2017 r.
- ❑ **Nowy Q&A TR 44: Transition to the new EMIR TS on reporting** – publikacja ESMA: luty 2017 r.

Nowy Q&A TR 44 dot. raportowania zmian do transakcji zaraportowanych przed datą wejścia w życie nowych standardów technicznych:

- ❑ kontrahenci będą zobowiązani do przesyłania raportów dot. aktywnych transakcji zaraportowanych przed datą wejścia w życie nowych RTS/ITS, tylko jeśli zaistnieje zdarzenie (np. terminacja, modyfikacja) wymagające zgłoszenia do RT; raporty te będą musiały być zgodne z nowymi standardami technicznymi;
- ❑ repozytoria transakcji będą zobowiązane do stosowania odpowiednich kontroli badających, czy raporty z korektą lub modyfikacją (AT=R lub AT=M) zgłoszone przez kontrahentów do tzw. „starych” aktywnych transakcji zawierają wszystkie niezbędne dane wymagane pod nowymi RTS;
 - Wyjątek: jeśli złożony kontrakt pochodny był pierwotnie zgłoszony w jednym raporcie, pod jednym identyfikatorem transakcji (UTI), to pod nowymi RTS, nie będzie musiał być podzielony na więcej raportów, jeśli będzie potrzeba zaraportowania do niego modyfikacji, czy korekty;
- ❑ brak obowiązku dostosowania do nowych RTS transakcji wygasłych przed 1 listopada 2017 r., pod warunkiem, że były zaraportowane poprawnie - jeśli kontrahent dostrzeże błąd w nieaktywnej transakcji, korekta będzie możliwa tylko zgodnie z nowymi walidacjami.

Nowe standardy techniczne EMIR:

- Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/104 z dnia 19 października 2016 r. zmieniające rozporządzenie delegowane (UE) nr 148/2013

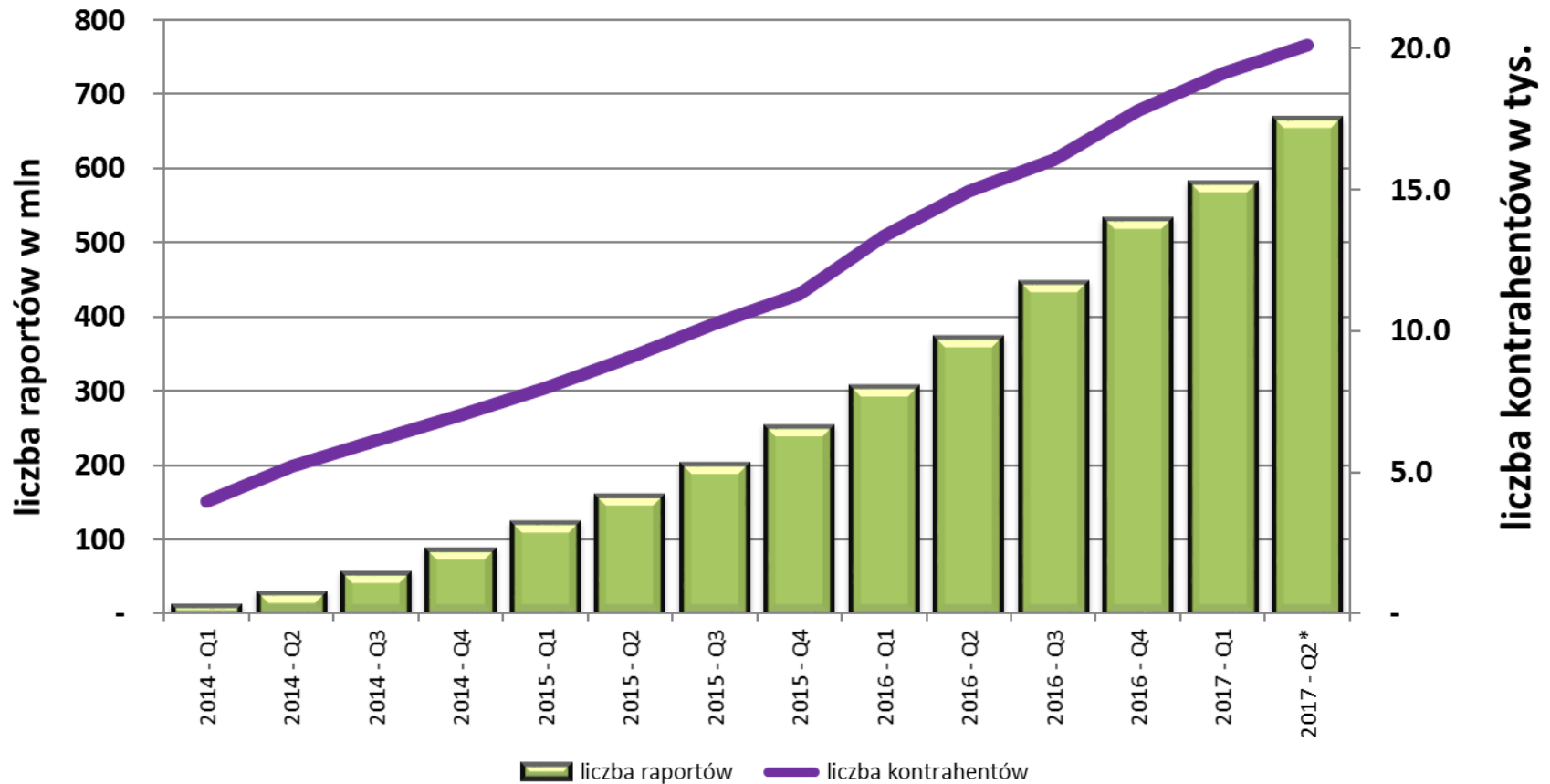
oraz

- Rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) 2017/105 z dnia 19 października 2016 r. zmieniające rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 1247/2012

opublikowane w Dzienniku Urzędowym UE w dniu 21 stycznia 2017,

obowiązują od 1 listopada 2017 r.

Liczba raportów przyjętych do KDPW_TR w mln (narastająco)
 Liczba kontrahentów, za których złożono raporty w tys. (narastająco)



**Zmiany w procesie raportowania: identyfikatory,
funkcjonalności, walidacje**

Proces migracji danych polegać będzie na zmapowaniu obecnie raportowanych wartości w poszczególnych polach do pól nowej struktury.

Przewiduje się stosowanie wszystkich poniższych scenariuszy mapowania pól pomiędzy strukturami RTS (w zależności od zakresu zaraportowanych danych):

- **pola przeniesione do nowych RTS bez zmian** (np. ID of the other counterparty)
- **pola zmieniające nazwę/format danych**
(np. Counterparty ID -> Reporting Counterparty ID)
- **pola, których fragmenty wpisywane będą w kilka nowych pól**
(np. Floating rate of leg 2 -> Floating rate reference period leg 2 – time period,
Floating rate reference period leg 2 – multiplier)
- **pola nowe, obowiązujące od nowych RTS** (np. Variation margin posted).

W zależności od scenariusza mapowania stosowanego dla danego pola, RT przeprowadzi odpowiednie procesy migracyjne oraz zapisze w bazie danych wersję RTS, w której obowiązywał raport (dla raportów z obecnych RTS będzie to np. 1). Pola które przestają obowiązywać w nowym RTS, zostaną nadal zapisane w bazie, jednakże nie będzie możliwości ich modyfikacji.

- ❑ Aktualizacja schemy komunikatów służących do raportowania KDPW_TR do normy ISO20022
- ❑ Modyfikacja układu raportu – umożliwienie raportowania danych na poziomie transakcji lub pozycji
 - Transakcja (Tx) – dostępne *action type*: New (New); Modification (Mod); Correction (Crrctn); Early Termination (EarlyTermntn); Position Component (PosCmpnt); Valuation Update (ValtnUpd); Compression (Cmprssn); Error (Err).
 - Pozycja (Pos) – dostępne *action type*: New (New); Modification (Mod); Correction (Crrctn); Early Termination (EarlyTermntn); Valuation Update (ValtnUpd); Error (Err).
- ❑ Nowe nazewnictwo – zmiana nazw tagów dla poszczególnych pól
- ❑ Nowa budowa tagów – atrybuty walut, przeniesienie definicji wartości na poziom tagu np. *Cena/ stawka* i *Oznaczenie ceny* – wyrażone za pomocą tagu Price (Pric) z opcjonalnymi tagami: MonetaryValue (MntryVal), Percentage (Pctg), Yield (Yld), PendingPrice (PdgPric).

□ Zmiany w komunikatach zbiorczych

- trar.ins.002.xx – zmiana powiązania komunikatu podstawowego z komunikatem zbiorczym – pole *Technical Underlying* (tag TechUndrlyg);
- trar.ins.003.xx – przeniesienie funkcjonalności na poziom komunikatu trar.ins.001.xx. Umożliwia się aktualizację zabezpieczenia na portfel za pośrednictwem komunikatu trar.ins.001.xx z wypełnioną jedynie sekcją Collateral w sekcji Valuation Update, bez podania UTI oraz z podaniem wartości 'Y' w polu Collateral portfolio (PrtflColl) oraz identyfikacją portfela w polach: Reporting Counterparty ID (RptgCtrPtyId) + ID of the Other Counterparty (OthrCtrPty) + Collateral Portfolio Code (Prtfl);
- Likwidacja komunikatów: trar.ins.004.xx, trar.ins.005.xx;
- Komunikat trar.ins.006.01 - zmiana kodu identyfikacyjnego kontrahenta.

❑ Komunikaty zwrotne

Utrzymany zostaje zakres informacyjny komunikatów zwrotnych trar.ack.001.xx, admi.err.001.xx, trar.sts.001.xx, trar.sts.002.xx oraz trar.sts.003.xx. W komunikatach zwrotnych trar.sts.xxx.xx ujednocicone zostaje nazewnictwo tagów.

❑ Komunikat przepytujący, komunikat notyfikacyjny

- Komunikat przepytujący nie ulega zmianom – zachowana zostaje jego funkcjonalność.
- Komunikat notyfikacyjny trar.ntf.001.xx generowany będzie przez system KDPW_TR w następujących przypadkach:
 - ✓ automatyczne wygaszenie transakcji w dacie zapadalności (AT=T)
 - ✓ notyfikacja w przypadku wysłania przez jednego z kontrahentów komunikatu anulującego raport (AT=E)
 - ✓ aktualizacja identyfikatora kontrahenta (po przetworzeniu komunikatu trar.ins.006.xx AT=L)

- ❑ Utrzymany zostaje trzystopniowy zakres walidacji raportów (potwierdzenie zgodności ze schemą xsd; potwierdzenie poprawności merytorycznej raportu; potwierdzenie danych zapisanych w bazie).
- ❑ Przepływy komunikatów – zachowana zostaje struktura przepływu komunikatów, przy czym dla komunikatu trar.ins.001.xx z aktualizacją zabezpieczenia na portfel (n transakcji), zwrótnie wysłanych zostanie n komunikatów trar.sts.001.xx z wylistowanymi wszystkimi transakcjami podlegającymi aktualizacji.

□ Identyfikacja stron:

- Identyfikacja podmiotu raportującego, kontrahenta, brokera oraz członka rozliczającego **wyłącznie na bazie kodu LEI** (wykluczenie możliwości raportowania na bazie innych identyfikatorów).
- Identyfikacja drugiego kontrahenta, beneficjenta za pomocą kodu LEI bądź kodu klienta (tylko w przypadku osoby fizycznej).
- Badanie **statusu kodu LEI** dla kontrahenta raportującego – *Reporting counterparty ID*: dopuszczalne statusy "Issued", "Pending transfer", "Pending archival".

EMIR – przesłanie raportu z identyfikacją kontrahenta raportującego (pole Reporting Counterparty ID) na bazie kodu różnego niż LEI nie będzie możliwe.

MiFIR – „No LEI, no trade” - zawarcie transakcji podlegającej raportowaniu MiFIR z klientem nie posiadającym kodu LEI nie będzie możliwe.

Zgodnie z Art. 13 ust. 2 Rozporządzenia Delegowanego nr 2017/590 z dn. 28 lipca 2016 roku uzupełniającego MiFIR, **firmy inwestycyjne powinny uzyskać kod LEI od swoich klientów przed rozpoczęciem świadczenia usług:**

„Firma inwestycyjna nie świadczy usługi, w wyniku której powstaje obowiązek dokonania zgłoszenia transakcji dotyczącego transakcji zawartej w imieniu klienta, który kwalifikuje się do posiadania kodu identyfikatora podmiotu prawnego, przed uzyskaniem kodu identyfikatora podmiotu prawnego od tego klienta”.

Ważność kodu LEI:

- Firmy inwestycyjne zgłaszające transakcję – kody LEI będą musiały być ważne (statusy takie, jak pod EMIR);
- Klienci – nie będzie badana ważność kodu LEI.

Niemniej jednak, jeśli transakcja podlegać będzie zarówno pod EMIR, jak i MiFIR, wszystkie powyższe warunki dotyczące obowiązkowości kodów LEI będą musiały być spełnione.

□ Aktualizacja identyfikatora – trar.ins.006.xx

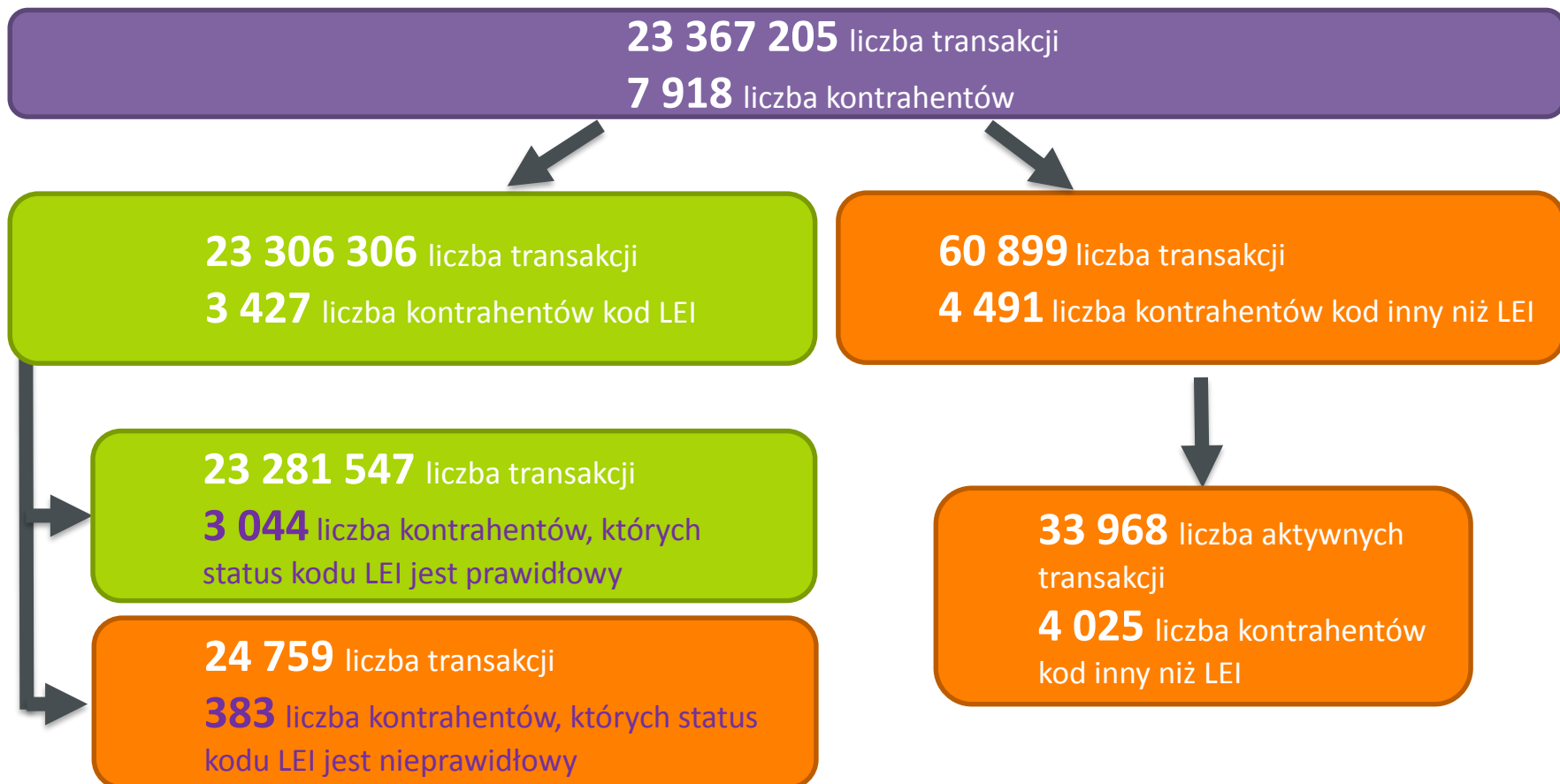
Dane zaraportowane na bazie kodu BIC bądź kodu klienta (dowolnego ciągu 50 znaków alfanumerycznych) powinny zostać zaktualizowane do kodów LEI do dnia wejścia w życie nowych standardów technicznych.

Zmiana identyfikatora na kod LEI będzie obsługiwana komunikatem trar.ins.006.xx, w którym zawarte będą następujące informacje:

- Client code,
- Kod LEI,
- Data obowiązywania.

Zmiana obejmie wszystkie aktywne na wskazaną datę obowiązywania raporty i zostanie zastosowana do pól: *Reporting Counterparty ID* oraz *ID of the other counterparty*.

Liczba transakcji przyjętych do KDPW_TR oraz poszczególnych identyfikatorów kontrahentów (CP1) w okresie 01.01.2017-21.06.2017



- ❑ Identyfikacja za pomocą kodu ISIN dotyczy pól:
 - Identyfikacja instrumentu bazowego
 - Identyfikacja produktu

❑ Identyfikacja instrumentu bazowego

Kod ISIN jest i pozostaje jedną z dopuszczalnych wartości identyfikujących instrument bazowy. Pozostałe wartości charakteryzujące instrument bazowy zamykają się w zbiorze: All, UPI (po jego zdefiniowaniu), dla koszyka - wszystkie poszczególne elementy składowe identyfikuje się przy użyciu kodu ISIN lub All, dla indeksu - kod ISIN bądź pełna nazwa indeksu nadana przez dostawcę indeksu.

❑ Identyfikacja produktu

Do dnia wejścia w życie standardów technicznych do MiFIR (w sprawie danych referencyjnych):

- Jeżeli pole *Venue of Execution* zawiera
 - ✓ kod MIC zapisany w Bazie Danych MiFID dotyczącej Rynku Regulowanego, dla którego identyfikatorem instrumentu określonym w tej bazie danych jest kod ISIN lub
 - ✓ kod "XOFF",
- to produkt identyfikuje się za pomocą kodu ISIN.
- Jeżeli pole *Venue of Execution* zawiera kod MIC zapisany w Bazie Danych MiFID dotyczącej Rynku Regulowanego, dla którego identyfikatorem instrumentu określonym w tej bazie danych jest kod All, to pole musi zawierać "A".
 - Jeżeli pole *Venue of Execution* zawiera
 - ✓ kod MIC zapisany w Bazie Danych MiFID dotyczącej Rynku Regulowanego, dla którego identyfikator instrumentu nie jest określony w tej bazie danych lub
 - ✓ kod MIC zapisany w Bazie Danych MiFID dotyczący platformy MTF lub
 - ✓ kod MIC dotyczący platformy obrotu w kraju spoza EOG lub
 - ✓ kod "XXXX",

to pole identyfikujące produkt może być niewypełnione.

❑ Identyfikacja produktu

Po dniu wejścia w życie standardów technicznych do MiFIR (w sprawie danych referencyjnych):

- Jeżeli pole *Venue of Execution* zawiera
 - ✓ kod MIC dotyczący platformy obrotu w kraju EOG lub
 - ✓ kod "XOFF",

to produkt identyfikuje się za pomocą kodu ISIN. W przeciwnym przypadku pole może być niewypełnione.

Zmiany w tabeli *Parties to the contract*

- Zmiana sposobu identyfikacji drugiego kontrahenta (*ID of the other counterparty*) – dodanie pola wskazującego kod kraju; w przypadku podania identyfikacji za pomocą kodu LEI, zaimplementowana zostaje dodatkowa **kontrola czy kod kraju jest zgodny z kodem przypisanym do danego LEI – dla danych niezgodnych komunikat będzie odrzucany**;
- Określenie wartości pola *corporate sector* – dodanie taksonomii dla podmiotów niefinansowych, pole obowiązkowe dla podmiotów finansowych i niefinansowych;
- Zniesienie obowiązkowości (na poziomie komunikatu KDPW_TR) pola *Report submitting entity ID*;
- Doszczegółowienie na poziomie rozporządzenia wykonawczego zasad definiowania pola *Counterparty side* – art. 3a;

Zmiany w tabeli *Parties to the contract*

Rozszerzenie zakresu informacyjnego sekcji zabezpieczeń o pola dotyczące wartości początkowego i zmiennego depozytu otrzymanego oraz przyjętej/złożonej nadwyżki zabezpieczenia – zastąpienie pól: *Value of collateral* oraz *Currency of the collateral value* polami:

- Initial margin posted
- Currency of the initial margin posted
- Variation margin posted
- Currency of the variation margin posted
- Initial margin received
- Currency of the initial margin received
- Variation margin received
- Currency of the variation margin received
- Excess collateral posted
- Currency of the excess collateral posted
- Excess collateral received
- Currency of the excess collateral received

Zmiany w tabelach *Common data*

Rozbicie tabeli *Contract type* na dwie tabele: *Contract type* oraz *Contract information*

CONTRACT TYPE

- Objęcie wszystkich transakcji obowiązkiem określenia wartości pól *Contract type* oraz *Asset class* – dotąd obowiązkowych tylko dla taksonomii E (pola *Product ID 1* i *Product ID 2*);
- Rozszerzenie zakresu wartości dopuszczalnych w polu *Contract type* (dodanie wartości SB i ST);
- Wykluczenie możliwości zdefiniowania pola *Asset class* za pomocą wartości OT;

CONTRACT INFORMATION

- Uszczegółowienie zakresu informacyjnego opisującego produkt oraz instrument bazowy – nowe pola:
 - ✓ Product classification type
 - ✓ Product classification
 - ✓ Product identification type
 - ✓ Product identification
 - ✓ Underlying identification type

Zmiany w tabelach *Common data*

DETAILS ON THE TRANSACTION

- ✓ Zmiana zakresu informacyjnego identyfikatora *Report tracking number*;
- ✓ Dodanie pola *Complex trade component ID*.
- ✓ Zmiana sposobu zdefiniowania pola *Price*;
- ✓ Zmiana definicji oraz zasad aktualizacji danych dla pola *Notional*.

INTEREST RATES

- ✓ Rozszerzenie zakresu danych raportowanych dla transakcji pochodnych na stopę procentową (z 8 pól do 22).
- ✓ Rozbicie danych dotąd raportowanych jako tekstowe na wyodrębnione wartości definiujące *time period* oraz *multiplier*. Dodanie dopuszczalnych do zraportowania wartości dla poszczególnych indeksów.

Zmiany w tabelach *Common data*

COMMODITY BASE

- ✓ Rozszerzenie zakresu dopuszczalnych wartości dla pola *Commodity base* o wartość OT;
- ✓ Rozszerzenie zakresu dopuszczalnych wartości dla poszczególnych grup: dodanie wartości OT w ramach słownika dla grupy AG, dodanie nowego słownika dla grupy FR, dodanie wartości OT w ramach słownika dla grupy EN;
- ✓ Rozszerzenie słownika dla pola *Load type* o wartości SH, GD;
- ✓ Dodanie pola *Load delivery intervals*;
- ✓ Dodanie pól *Duration* oraz *Days of the week*, powiązane ze zmianą formatu danych raportowanych w ramach pola *Delivery capacity* (stara nazwa *Contract capacity*);
- ✓ Zdefiniowanie formatu danych dla pola *Quantity Unit*.

OPTION TYPE

- ✓ Rozszerzenie zakresu dopuszczalnych wartości dla pola *Option type* o wartość O;
- ✓ Dopuszczenie raportowania wielu wartości w polu *Option exercise style*;
- ✓ Dodanie pól: *Strike price notation*, *Maturity date of the underlying*.

Zmiany w tabelach *Common data*

Dodanie sekcji definiującej instrumenty kredytowe **CREDIT DERIVATIVES** obejmującej pola:

- ✓ Seniority
- ✓ Reference entity
- ✓ Frequency of payment
- ✓ The calculation basis
- ✓ Series
- ✓ Version
- ✓ Index factor
- ✓ Tranche
- ✓ Attachment point
- ✓ Detachment point

Raportowanie transakcji a raportowanie pozycji

Różnice w zakresie danych obligatoryjnych w raporcie o transakcji oraz o pozycji
pola obligatoryjne dla transakcji, opcjonalne dla pozycji (mogą pozostać niewypełnione)

- Price/ rate
- Price notation
- Execution timestamp
- Effective date

pola z dopuszczalnymi innymi wartościami

- Quantity – wartość „0” dopuszczalna jedynie w raporcie o pozycji

Na poziomie pozycji nie ma możliwości raportowania kompresji (AT=Z) oraz transakcji zamykanej na koniec dnia, wchodzącej w skład raportu o pozycji - *position component* (AT=P).

Raport o transakcji pozostaje raportem obowiązkowym.

Raportowanie *post-trade events* na poziomie pozycji jest możliwe, o ile spełnione zostały przesłanki wyszczególnione w TR Q&A 17 (w szczególności przekazany został raport o transakcji).

Raportowanie transakcji podlegających obowiązkowi raportowemu EMIR i MiFIR

- ❑ Obowiązek zgłaszania transakcji przez firmy inwestycyjne – Art. 26 MiFIR, zastosowanie **od 3 stycznia 2018 roku.**
- ❑ Wytyczne ESMA w zakresie raportowania transakcji pod MiFIR: „Technical Reporting Instructions. MiFIR Transaction Reporting” – dokument opublikowany w dniu 21 października 2016:
- ❑ Raporty o transakcjach przekazywane są do władz właściwych przez:
 - firmy inwestycyjne zawierające transakcje, których przedmiotem są instrumenty finansowe;
 - zatwierdzone mechanizmy sprawozdawcze (ARM) działające w imieniu firm inwestycyjnych;
 - operatorów systemów obrotu, za pośrednictwem których zrealizowano transakcję
- ❑ **ARM** (*ang. Approved Reporting Mechanism, pol. Zatwierdzony Mechanizm Sprawozdawczy*) - zgodnie z definicją zawartą w MiFID oznacza **osobę upoważnioną do świadczenia usług polegających na zgłaszaniu szczegółów transakcji właściwym organom lub ESMA w imieniu firm inwestycyjnych.**

Pod Rozporządzeniem MiFIR obowiązkowi raportowania podlegają transakcje w instrumentach finansowych:

- które zostały dopuszczone do obrotu lub są przedmiotem obrotu w systemie obrotu lub w odniesieniu do których złożono wnioski o dopuszczenie do obrotu (Art. 26, ust. 2a MiFIR);
- których instrumentem bazowym jest instrument finansowy będący przedmiotem obrotu w systemie obrotu (Art. 26, ust. 2b MiFIR);
- których instrumentem bazowym jest indeks lub koszyk instrumentów finansowych będących przedmiotem obrotu w systemie obrotu (Art. 26, ust. 2c MiFIR).

Obowiązek raportowania dotyczy transakcji w wyżej wymienionych instrumentach finansowych niezależnie od tego, czy transakcje te zawierane są w systemie obrotu.

□ FIRDS (Financial Instrument Reference Data System):

- Zgodnie z Art. 27 MiFIR systemy obrotu oraz podmioty systematycznie internalizujące transakcje są zobowiązane do dostarczenia właściwym organom oraz ESMA identyfikacyjnych danych referencyjnych instrumentu finansowego.
- Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) nr 2017/585 - standardy techniczne określające normy i format danych przesyłanych do FIRDS.

Raportowanie danych podlegających obowiązkowi raportowemu EMIR oraz MiFIR możliwe będzie dla Uczestników KDPW_TR w trybie TR, co w komunikacie trar.ins.001.xx znajduje odzwierciedlenie w wyodrębnionej sekcji MIFIRReportingData.

TRYB RT

- Raportowanie do ARM **wyłącznie** przez uczestników KDPW_TR.
- Możliwość opcjonalnego (wg wskazań uczestnika) przekazywania raportów pod EMIR i MiFIR – dotychczasowe raporty przesyłane pod EMIR będą mogły być wzbogacone o pola wymagane pod MiFIR/MiFID II – **jednoczesne wywiązanie się z dwóch obowiązków.**

- ❑ Rozszerzony komunikat własny xml RT (trar.ins):
 - **pole/znacznik REG (E- EMIR, M-MiFIR, B-oba reżimy)** – możliwość wskazania w raporcie obowiązku raportowego, którego dotyczy dany raport; brak znacznika oznaczać będzie raportowanie wyłącznie pod EMIR;
 - wprowadzenie **sekcji obowiązkowych** dla raportów oznaczonych **znacznikiem B lub M** (czyli dot. MiFIR):
 - ✓ w komunikacie oznaczonym REG=B (wspólnym dla MiFIR i EMIR) sekcje **General Information, Counterparty information** oraz **Trade data details** będą wspólne dla obydwu regulacji; w przypadku powtórzenia sekcji Counterparty information (podobnie, jak to jest teraz pod EMIR) ARM wygeneruje raporty za obie strony; sekcja **Valuation and Collateral** obejmie tylko raport pod EMIR;
 - walidacje merytoryczne:
 - ✓ wynikające z wymagań regulacji MiFIR - zaimplementowane na poziomie usługi ARM
 - ✓ wynikające z wymagań pod EMIR – na dotychczasowych zasadach.
- ❑ **Informacje zwrotne** przesyłane do Uczestników:
 - komunikaty statusowe: auth.031;
 - kopie raportów wysłanych do NCAs: auth.016;
 - komunikaty zwrotne do auth.clt (dane osobowe): auth.stc.

Raportowanie transakcji podlegających obowiązkowi raportowemu EMIR oraz MiFIR (2)

- ❑ Repozytorium Transakcji rejestruje wyłącznie transakcje podlegające raportowaniu zgodnie z EMIR (+ ewentualnie równoległe z MiFIR – w trybie RT).
- ❑ **Action Type (AT)**, przekazywany w każdym komunikacie trar.ins.001, będzie wskazywać zarówno na procesowanie związane z raportowaniem pod EMIR, jak i na sposób generowania komunikatów do ARM przez Repozytorium, w zależności od znacznika REG.
- ❑ Opcje rejestracji raportów AT=N w KDPW_TR:

Rodzaj zmiany w EMIR (AT)	REG (znacznik w komunikacie trar.ins)	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 EMIR uzupełnia o przesłane wcześniej dane z bazy RT, po sprawdzeniu, że takie istnieją. Jeśli brak transakcji w bazie EMIR, to komunikat jest odrzucany.
	B	RT zapisuje informacje w bazie EMIR i generuje komunikat do ARM: NEW

Raportowanie transakcji podlegających obowiązkowi raportowemu EMIR oraz MiFIR (3)

❑ Opcje korekty raportów AT=R w KDPW_TR:

Rodzaj zmiany w EMIR (AT)	REG (znacznik w komunikacie trar.ins)	Działanie RT
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	czy też 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.

❑ Opcje usunięcia raportów AT=E

Rodzaj zmiany w EMIR (AT)	REG (znacznik w komunikacie trar.ins)	Działanie RT
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).

Nowe typy uczestnictwa

- ❑ **Uczestnik raportujący niebędący stroną kontraktu (TUR)** – podmiot uprawniony do raportowania tylko i wyłącznie w imieniu innego podmiotu, jako instytucja pośrednicząca (nie będąca stroną kontraktu); posiada uprawnienia do wprowadzania, modyfikowania, usuwania raportów, w których występuje, jako podmiot raportujący, jednocześnie ma możliwość przeglądania raportów, które zgłosił; może wykorzystywać zarówno kanał WEB jak i kanał MQ.
- ❑ **Indywidualny uczestnik raportujący (IUR)** - podmiot uprawniony do raportowania wyłącznie w imieniu własnym; posiada uprawnienia do wprowadzania, modyfikowania, usuwania danych, w których występuje, jako raportujący, jednocześnie ma możliwość przeglądania raportów, które zgłosił oraz danych o transakcjach i pozycjach zaraportowanych przez innych raportujących, w których jest stroną; może wykorzystywać zarówno kanał WEB jak i kanał MQ.

Harmonogram

21.01.2017	publikacja standardów technicznych przez Komisję Europejską
04.04.2017	publikacja tabel walidacyjnych oraz zaktualizowanych <i>Question and Answers</i> przez ESMA
14.06.2017	przekazanie Uczestnikom dokumentacji systemu KDPW_TR (opis funkcjonalności, schemy xsd, zasady mapowania)
26.06.2017	spotkanie z Uczestnikami
09.2017	udostępnienie Uczestnikom środowiska testowego
01.11.2017	wejście w życie nowych Standardów Technicznych EMIR

KDPW

Dział Repozytorium Transakcji

repository@kdpw.pl

arm@kdpw.pl

lei_service@kdpw.pl

+ 48 22 537 96 40

KDPW | **TR**

KDPW | **ARM**

KDPW | **LEI**