

Opis procesu rekonyliacji danych w raportach zgłaszanych do KDPW_TR

Spis treści

I.	Wstęp	2
II.	Parowanie raportów.....	3
III.	Porównywanie szczegółów transakcji w sparowanych raportach	4
IV.	Informacja o wynikach procesu dla uczestników raportujących	19

I. Wstęp

Strony kontraktów terminowych, zawieranych na poszczególnych klasach instrumentów pochodnych podlegających zgodnie z Rozporządzeniem EMIR obowiązkowi raportowania, zobowiązane są do uzgadniania szczegółów transakcji w oparciu o opublikowane standardy techniczne. Repozytorium KDPW_RT, wraz z innym autoryzowanymi repozytoriami, wspomaga ten proces parując i porównując szczegóły transakcji raportowanych przez strony oddzielnie. Proces rekonyliacji danych został uzgodniony pomiędzy repozytoriami transakcji i zaakceptowany przez ESMA.

Zgodnie z Rozporządzeniem EMIR, strony transakcji mają czas na zaraportowanie transakcji T + 1 (dni roboczych) w stosunku do daty (T) zawarcia kontraktu lub zmian jego warunków. W związku z tym, proces parowania i porównywania danych przeprowadzany jest w dniu T + 2 każdego dnia od poniedziałku do piątku nie wyłączając dni świątecznych. Raporty o pozycjach nie są włączane do procesu rekonyliacji. Wynikiem procesu jest oznaczenie statusu parowania i porównywania raportów. Informacje te przesyłane są do uczestników raportujących w formie komunikatu xml, codziennie po zakończeniu procesu.

Weryfikowanie zgodności szczegółów transakcji realizowane jest w dwóch etapach. W pierwszym kroku przeprowadzane jest parowanie raportów polegające na wyszukiwaniu raportu złożonego przez drugą stronę. Następnie pola sparowanych raportów podlegają porównaniu zgodnie z założonymi tolerancjami. Poniżej przedstawione zostaną szczegóły obydwu tych etapów oraz szczegóły dotyczące informowania uczestników o wynikach procesu rekonyliacji.

II. Parowanie raportów

Parowanie to powiązanie ze sobą dwóch raportów o transakcji na podstawie UTI oraz kodów LEI kontrahentów (UTI, LEI1, LEI2).

Parowanie raportów zachodzi dwuetapowo. W pierwszym etapie parowane są raporty złożone przed obie strony do KDPW_TR (tzw. parowanie wewnętrzne). Następnie, po odebraniu z innych RT informacji o poszukiwanych przez nie raportach, przeprowadzane jest parowanie zewnętrzne dla wszystkich raportów, które nie znalazły pary w KDPW_TR. Informacja o tym, które repozytorium przechowuje raport o sparowanej transakcji jest zapisywana w bazie KDPW_TR.

Raporty sparowane (wewnętrznie lub zewnętrznie) otrzymują status parowania YPAR, a data parowania zapisywana jest w bazie KDPW_TR. Raporty niesparowane otrzymują status NPAR i trafiają do parowania w kolejnym dniu roboczym, aż do momentu sparowania. Po siedmiu dniach roboczych raporty nieaktywne NPAR są wyłączane z codziennego procesu rekonyliacji, jednakże nadal przechowywane w bazie. W dniu, w którym druga strona transakcji prześle swój raport do KDPW_TR bądź do innego RT, wyłączony raport zostaje odnaleziony w bazie RT i ponownie włączony do procesu. Obydwa raporty otrzymują status YPAR i są włączane do procesu porównywania.

Do procesu rekonyliacji włączane są tylko te raporty, w których podano poprawne kody LEI kontrahentów oraz poprawny identyfikator UTI.

Walidacja identyfikatorów transakcji odbywa się według poniższych zasad:

- **Identyfikator LEI walidujemy zgodnie z bazą LEI. Baza jest aktualizowana każdego dnia roboczego RT na podstawie danych zaczytywanych z GLEIF i przetworzona na koniec dnia księgowego w RT.**
- **Kod LEI uznawany jest za ważny, jeśli jego status jest ISSUED, TRANSFERRED, PEDNING TRANSFER, PENDING ARCHIVAL lub LAPSED.**
- **Walidacja UTI: do rekonyliacji włączane są tylko UTI zawierające liczby i litery oraz 4 znaki specjalne: '-','_',';',':'.**

Proces walidacji kodów LEI przeprowadzany jest przy wejściu komunikatu do RT, jednakże powtórna walidacja LEI jest przeprowadzana codziennie przy generowaniu rejestru rekonyliacji, w ten sposób wszystkie raporty, których status LEI uległ zmianie mogą być włączane do rekonyliacji.

W komunikatach RCN przekazywane są informacje o wyłączeniu transakcji z procesu ze względu na nieprawidłowy kod UTI lub kod LEI jednego z kontrahentów w formie następujących statusów:

- Nieprawidłowy kod LEI 1 – status ERL1;
- Nieprawidłowy kod LEI 2 – status ERL2;
- Nieprawidłowy kod UTI – status ERUT;

III. Porównywanie szczegółów transakcji w sparowanych raportach

Wszystkie sparowane wewnętrznie lub zewnętrznie raporty są włączane do procesu porównywania. W procesie tym porównywane są szczegóły transakcji w polach wskazanych w poniższej tabeli (Tabela 1).

W kolumnie trzeciej wskazano rodzaj zastosowanej w porównaniu tolerancji zgodności:

- i. Tolerancja 1: Różnica wartości kwotowych dot. porównywanych transakcji nie może przekraczać 1%.
- ii. Tolerancja 2: Wartości kwotowe dot. porównywanych transakcji muszą być identyczne na lewo od przecinka wartości ułamkowych.
- iii. Tolerancja 3: Dla OTC data i czas porównywanych transakcji muszą zestawiać się, co do daty transakcji, dla ETD dodatkowo różnica porównywanych czasów nie może przekraczać 1 godziny.
- iv. Tolerancja 4: Data i czas porównywanych transakcji muszą zestawiać się, co do daty transakcji

Zasady porównywania szczegółów transakcji

Pola w poniższej tabeli zostały podzielone poniższe kategorie:

- **Kategoria 1** – Pole poddane zostanie porównaniu; jeśli wszystkie pola kategorii 1 są zgodne to raporty uznaje się za zmaczowane (matched)
- **Kategoria 2** – Pole poddane zostanie porównaniu; jeśli wszystkie pola kategorii 1 i 2 są zgodne to raporty uznaje się za zrekoncyliowane (reconciled)
- **Kategoria 0** – Wartość pola nie będzie poddawana procesowi porównywania.

Tabela 1.

Porównywanie pól zachodzi zgodnie z poniższą tabelą.

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Counterparty side	B = Buyer S = Seller Populated in accordance with Article 3a	T	1	Jeśli pierwsza strona = 'S' to druga musi być równa 'B' i na odwrót.
Contract type	CD = Financial contracts for difference FR = Forward rate agreements FU = Futures FW = Forwards OP = Option SB = Spreadbet SW = Swap ST = Swaption OT = Other	T	1	Musi się zestawiać

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Asset class	CO = Commodity and emission allowances CR = Credit CU = Currency EQ = Equity IR = Interest Rate	T	1	Musi się zestawić
Product classification type	C = CFI U = UPI	T	2	Musi się zestawić
Product classification	ISO 10692 CFI, 6 characters alphabetical code Endorsed UPI	T	2	Tylko pierwsze 2 znaki kodu
Product identification type	Specify the applicable identification: I = ISIN A = All	T	1	Musi się zestawić
Product identification	For product identifier type I: ISO 6166 ISIN 12 character alphanumerical code For product identifier type A: Complete All code in accordance with Article 4(8)	T	1	Musi się zestawić jeśli w polu 2.5 podano ISIN.
Underlying identification type	I = ISIN A = All U = UPI B = Basket X = Index	T	1	Musi się zestawić
Underlying identification	For underlying identification type I: ISO 6166 ISIN 12 character alphanumerical code For underlying identification type A: complete All code in accordance with Article 4(8) For underlying identification type U: UPI For underlying identification type B: all individual components identification through ISO 6166 ISIN or complete All code in accordance with Article 4(8). Identifiers of individual components shall be separated with a dash "-". For underlying identification	T	1	Musi się zestawić jeśli pole Underlying identification typ = I, U, NA lub X. Nie jest porównywane jeśli pole Underlying identification typ=B lub A. • Jeżeli Underlying identification type = X oraz Underlying identification = ISIN (12 alfanumeryczne znaki) co najmniej 1

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
	type X: ISO 6166 ISIN if available, otherwise full name of the index as assigned by the index provider			CP raportującego – musi się zestawić • Jeżeli Underlying identification type = X oraz Underlying identification nie jest ISIN (12 alfanumeryczne znaki) – nie jest porównywane To pole musi być wypełnione tylko wtedy, gdy wartość to ISIN (Underlying type = X)
Notional currency 1	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical characters	T	1	Musi się zestawić
Notional currency 2	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical characters	T	1	Musi się zestawić
Deliverable currency	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical characters	N	0	Nie jest porównywane
Report tracking number	An alphanumeric field up to 52 characters	N	0	Nie jest porównywane
Complex trade component ID	An alphanumeric field up to 35 characters	N	0	Nie jest porównywane
Venue of execution	ISO 10383 Market Identifier Code (MIC), 4 alphanumeric characters in accordance with Article 4(b).	T	2	Musi się zestawić
Compression	Y = contract results from compression N = contract does not result from compression	Y	2	Musi się zestawić

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Price / rate	Up to 20 numerical characters including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character. In case the price is reported in percent values, it should be expressed as percentage where 100% is represented as "100"	T	2	Zastosuj tolerancję 1
Price notation	U = Units P = Percentage Y = Yield	T	1	Musi się zestawić
Currency of price	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetic characters	T	1	Musi się zestawić
Notional	Up to 20 numerical characters including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	T	1	Zastosuj tolerancję 2.
Price multiplier	Up to 20 numerical characters including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot.	T	1	Zastosuj tolerancję 1.
Quantity	Up to 20 numerical characters including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot.	T	1	Musi się zestawić

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Up-front payment	Up to 20 numerical characters including decimals. The negative symbol to be used to indicate that the payment was made, not received. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	N	0	Nie jest porównywane
Delivery type	C = Cash P = Physical O = Optional for counterparty or when determined by a third party	T	2	Musi się zestawić
Execution timestamp	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	T	2	Zastosuj tolerancję 3.
Effective date	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	T	2	Musi się zestawić
Maturity date	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	T	1	Musi się zestawić
Termination date	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	T	2	Musi się zestawić
Settlement date	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	N	0	Nie jest porównywane
Master Agreement type	Free Text, field of up to 50 characters, identifying the name of the Master Agreement used, if any	N	0	Nie jest porównywane
Master Agreement version	ISO 8601 date in the format YYYY	N	0	Nie jest porównywane

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Confirmation timestamp	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	T	2	Porównywane tylko gdy pole Confirmation Means = E lub N Zastosuj tolerancję 4.
Confirmation means	Y = Non-electronically confirmed N = Non-confirmed E = Electronically confirmed	T	2	Musi się zestawić
Clearing obligation	Y = Yes N = No	T	2	Musi się zestawić
Cleared	Y = Yes N = No	T	1	Musi się zestawić
Clearing timestamp	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	T	2	Zastosuj tolerancję 4.
CCP	ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) 20 alphanumeric character code.	T	2	Musi się zestawić
Intragroup	Y = Yes N = No	T	2	Nie jest porównywane
Fixed rate of leg 1	Up to 10 numerical characters including decimals expressed as percentage where 100% is represented as "100". The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	T	2	Sortowanie values based on Fixed Rate rosnąco i porównania
Fixed rate of leg 2	Up to 10 numerical characters including decimals expressed as percentage where 100% is represented as "100". The decimal mark is not counted as a numerical	T	2	Sortowanie values based on Fixed Rate rosnąco i porównania

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
	character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.			
Fixed rate day count leg 1	Numerator/Denominator where both, Numerator and Denominator are numerical characters or alphabetic expression 'Actual', e.g. 30/360 or Actual/365	N	0	Nie jest porównywane
Fixed rate day count leg 2	Numerator/Denominator where both, Numerator and Denominator are numerical characters or alphabetic expression 'Actual', e.g. 30/360 or Actual/365	N	0	Nie jest porównywane
Fixed rate payment frequency leg 1 –time period	Time period describing how often the counterparties exchange payments, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Fixed rate payment frequency leg 1 – multiplier	Integer multiplier of the time period describing how often the counterparties exchange payments. Up to 3 numerical characters.	N	0	Nie jest porównywane
Fixed rate payment frequency leg 2 – time period	Time period describing how often the counterparties exchange payments, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Fixed rate payment frequency leg 2 - multiplier	Integer multiplier of the time period describing how often the counterparties exchange	N	0	Nie jest porównywane

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
	payments. Up to 3 numerical characters.			
Floating rate payment frequency leg 1 – time period	Time period describing how often the counterparties exchange payments, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate payment frequency leg 1 – multiplier	Integer multiplier of the time period describing how often the counterparties exchange payments. Up to 3 numerical characters.	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate payment frequency leg 2 – time period	Time period describing how often the counterparties exchange payments, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate payment frequency leg 2 – multiplier	Integer multiplier of the time period describing how often the counterparties exchange payments. Up to 3 numerical characters.	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate reset frequency leg 1 – time period	Time period describing how often the counterparties reset the floating rate, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate reset frequency leg 1 - multiplier	Integer multiplier of the time period describing how often the counterparties reset the floating rate. Up to 3 numerical characters.	N	0	Nie jest porównywane

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Floating rate reset frequency leg 2- time period	Time period describing how often the counterparties reset the floating rate, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate reset frequency leg 2 - multiplier	Integer multiplier of the time period describing how often the counterparties reset the floating rate. Up to 3 numerical characters.	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate of leg 1	‘EONS’ - EONIA SWAP ‘EURI’ - EURIBOR ‘EUUS’ – EURODOLLAR ‘EUCH’ - EuroSwiss ‘GCFR’ - GCF REPO ‘ISDA’ - ISDAFIX ‘LIBI’ - LIBID ‘LIBO’ - LIBOR ‘MAAA’ – Muni AAA ‘PFAN’ - Pfandbriefe ‘TIBO’ - TIBOR ‘STBO’ - STIBOR ‘BBSW’ - BBSW ‘JIBA’ - JIBAR ‘BUBO’ - BUBOR ‘CDOR’ - CDOR ‘CIBO’ - CIBOR ‘MOSP’ - MOSPRIM ‘NIBO’ - NIBOR ‘PRBO’ - PRIBOR ‘TLBO’ - TELBOR ‘WIBO’ – WIBOR ‘TREA’ – Treasury ‘SWAP’ – SWAP ‘FUSW’ – Future SWAP Or up to 25 alphanumerical characters if the reference rate is not included in the above list	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate reference period leg 1 – time period	Time period describing reference period, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate reference period leg 1 – multiplier	Integer multiplier of the time period describing the reference period. Up to 3 numerical characters.	N	0	Nie jest porównywane

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Floating rate of leg 2	'EONS' - EONIA SWAP 'EURI' - EURIBOR 'EUUS' – EURODOLLAR 'EUCH' - EuroSwiss 'GCFR' - GCF REPO 'ISDA' - ISDAFIX 'LIBI' - LIBID 'LIBO' - LIBOR 'MAAA' – Muni AAA 'PFAN' - Pfandbriefe 'TIBO' - TIBOR 'STBO' - STIBOR 'BBSW' - BBSW 'JIBA' - JIBAR 'BUBO' - BUBOR 'CDOR' - CDOR 'CIBO' - CIBOR 'MOSP' - MOSPRIM 'NIBO' - NIBOR 'PRBO' - PRIBOR 'TLBO' - TELBOR 'WIBO' – WIBOR 'TREA' – Treasury 'SWAP' – SWAP 'FUSW' – Future SWAP Or up to 25 alphanumerical characters if the reference rate is not included in the above list	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate reference period leg 2 – time period	Time period describing reference period, whereby the following abbreviations apply: Y = Year M = Month W = Week D = Day	N	0	Nie jest porównywane
Floating rate reference period leg 2 –multiplier	Integer multiplier of the time period describing the reference period. Up to 3 numerical characters.	N	0	Nie jest porównywane
Delivery currency 2	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical character code	N	0	Nie jest porównywane
Exchange rate 1	Up to 10 numerical digits including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	Y	2	Kontrola tolerancja 1 tj. wartości po każdej stronie transakcji muszą zawierać się w granicach 1% względem siebie.

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Forward exchange rate	Up to 10 numerical digits including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	Y	2	Kontrola tolerancja 1 tj. wartości po każdej stronie transakcji muszą zawierać się w granicach 1% względem siebie.
Exchange rate basis	Two ISO 4217 currency codes separated by "/". First currency code shall indicate the base currency, and the second currency code shall indicate the quote currency.	Y	1	Musi się zestawić
Commodity base	AG = Agricultural EN = Energy FR = Freights ME = Metals IN = Index EV = Environmental EX = Exotic OT = Other	T	1	Musi się zestawić
Commodity details	Agricultural GO = Grains oilseeds DA = Dairy LI = Livestock FO = Forestry SO = Softs SF = Seafood OT = Other Energy OI = Oil NG = Natural gas CO = Coal EL = Electricity IE = Inter-energy OT = Other Freights DR = Dry WT = Wet OT = Other Metals PR = Precious NP = Non-precious Environmental WE = Weather EM = Emissions OT = Other	T	2	Musi się zestawić
Delivery point or zone	EIC code, 16 character alphanumeric code Repeatable field.	N	0	Nie jest porównywane

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Interconnection Point	EIC code, 16 character alphanumeric code	N	0	Nie jest porównywane
Load type	BL = Base Load PL = Peak Load OP = Off-Peak BH = Hour/Block Hours SH = Shaped GD = Gas Day OT = Other	N	0	Nie jest porównywane
Load delivery intervals	hh:mmZ	N	0	Nie jest porównywane
Delivery start date and time	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	N	0	Nie jest porównywane
Delivery end date and time	ISO 8601 date in the UTS time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	N	0	Nie jest porównywane
Duration	N=Minutes H= Hour D= Day W=Week M=Month Q = Quarter S= Season Y= Annual O=Other	N	0	Nie jest porównywane
Days of the week	WD = Weekdays WN = Weekend MO = Monday TU = Tuesday WE = Wednesday TH = Thursday FR = Friday SA = Saturday SU = Sunday Multiple values separated by "/" are permitted	N	0	Nie jest porównywane
Delivery capacity	Up to 20 numerical digits including decimals The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	N	0	Nie jest porównywane

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Quantity Unit	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	N	0	Nie jest porównywane
Price/time interval quantities	Up to 20 numerical characters including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	N	0	Nie jest porównywane
Option type	P = Put C = Call O = where it cannot be determined whether it is a call or a put	T	1	Musi się zestawić
Option exercise style	A = American B = Bermudan E = European S = Asian More than one value is allowed	T	2	Musi się zestawić
Strike price (cap/floor rate)	Up to 20 numerical characters including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character. Where the strike price is reported in percent values, it should be expressed as percentage where 100% is represented as "100"	T	1	Zastosuj tolerancję 1.
Strike price notation	U = Units P = Percentage Y = Yield	T	1	Musi się zestawić

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Maturity date of the underlying	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	T	1	Musi się zestawić
Seniority	SNDB = Senior, such as Senior Unsecured Debt (Corporate/Financial), Foreign Currency Sovereign Debt (Government), SBOD = Subordinated, such as Subordinated or Lower Tier 2 Debt (Banks), Junior Subordinated or Upper Tier 2 Debt (Banks), OTHR = Other, such as Preference Shares or Tier 1 Capital (Banks) or other credit derivatives	T	2	Musi się zestawić
Reference entity	ISO 3166 - 2 character country code or ISO 3166-2 - 2 character country code followed by dash "-" and up to 3 alphanumeric character country subdivision code or ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) 20 alphanumeric character code	Y	2	Musi się zestawić
Frequency of payment	MNTH = Monthly QURT = Quarterly MIAN = Semi-annually YEAR = Yearly	T	2	Musi się zestawić
The calculation basis	Numerator/Denominator where both, Numerator and Denominator are numerical characters or alphabetic expression 'Actual', e.g. 30/360 or Actual/365	N	0	Nie jest porównywane
Series	Integer field up to 5 characters	T	2	Musi się zestawić
Version	Integer field up to 5 characters	T	2	Musi się zestawić

Nazwa pola	Format	Czy pole jest włączone do porównania	Kategoria porównania	Zasada porównania
Index factor	Up to 10 numerical characters including decimals. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot.	T	2	Zastosuj tolerancję 1.
Tranche	T= Tranched U=Untranchd	T	2	Musi się zestawić
Attachment point	Up to 10 numerical characters including decimals expressed as a decimal fraction between 0 and 1. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot.	T	2	Zastosuj tolerancję 1.
Detachment point	Up to 10 numerical characters including decimals expressed as a decimal fraction between 0 and 1. The decimal mark is not counted as a numerical character. If populated, it shall be represented by a dot.	T	2	Zastosuj tolerancję 1.
Action type	N = New M = Modify E = Error C = Early Termination R = Correction Z = Compression V = Valuation update P = Position component	N	0	Nie jest porównywane
Level	T = Trade P = Position	N	0	Nie jest porównywane

IV. Informacja o wynikach procesu dla uczestników raportujących

O wynikach procesu rekonyliacji danych KDPW_TR informuje uczestnika raportującego w formie komunikatu trar.rcn.001.03, który wysyłany jest po zakończeniu procesu porównywania, zwykle w godzinach popołudniowych każdego dnia od poniedziałku do piątku nie wyłączając dni świątecznych. Komunikat trar.rcn.001.03 przesłany zostaje tym samym kanałem (U2A/ A2A) jakim przesłane zostały do KDPW_TR dane podlegające procesowi rekonyliacji. Struktura komunikatu opublikowana jest na stronie internetowej KDPW_RT. Komunikat z założenia zawiera dane dotyczące raportów, które nie zostały sparowane (status parowania NPAR) lub w których występują błędy kategorii 1 lub 2 (status porównania ERR1 lub ERR2). W komunikacie przekazywane są poniższe informacje:

- ✓ data parowania - w przypadku raportów niesparowanych wpisywana jest data ostatniej próby parowania raportu, w przypadku raportów sparowanych data sparowania raportów;
- ✓ data porównania – wypełniana tylko dla raportów sparowanych i porównanych, data ostatniego porównania raportów;
- ✓ data obowiązywania szczegółów raportu – data, na którą obowiązują dane dot. szczegółów raportu wziętych do porównania;
- ✓ klucz transakcji (UTI, LEI1, LEI2);
- ✓ status parowania i porównywania;
- ✓ kod i opis błędu wskazującego pole, w którym występuje rozbieżność;
- ✓ wartości w raportach obu kontrahentów (w przypadku rozbieżności).

Lista możliwych kodów przyczyn błędów RsnCd dla statusów nieskutecznego porównania raportów StsCd = ERCD, ERR1 bądź ERR2 została przedstawiona w tabeli 2 poniżej:

Tabela 2.

Status	Kod błędu	Opis kodu błędu
ERCD	CPCT	Value in field Subject to EMIR obligation inconsistent with other counterparty report
	ERL1	Invalid LEI in field Reporting Counterparty ID
	ERL2	Invalid LEI in field ID of the Other Counterparty
	ERUT	Invalid UTI
ERR1/ERR2	ECPS	Inconsistency in field Counterparty side
	ECTP	Inconsistency in field Contract type

EASC	Inconsistency in field Asset class
EPDT	Inconsistency in field Product classification type
EPDC	Inconsistency in field Product classification - 2 first characters
EPTP	Inconsistency in field Product identification type
EPID	Inconsistency in field Product identification
EUTP	Inconsistency in field Underlying identification type
EUID	Inconsistency in field Underlying identification
ENC1	Inconsistency in field Notional currency 1
ENC2	Inconsistency in field Notional currency 2
EVOE	Inconsistency in field Venue of execution
ECMP	Inconsistency in field Compression
EPRT	Inconsistency in field Price / rate
EPNT	Inconsistency in field Price notation
ECOP	Inconsistency in field Currency of price
ENOT	Inconsistency in field Notional
EPMT	Inconsistency in field Price multiplier
EQNT	Inconsistency in field Quantity
EDEL	Inconsistency in field Delivery type
EEXC	Inconsistency in field Execution timestamp
EEFF	Inconsistency in field Effective date

EMTR	Inconsistency in field Maturity date
ETRM	Inconsistency in field Termination date
ECNF	Inconsistency in field Confirmation timestamp
ECNM	Inconsistency in field Confirmation means
ECLO	Inconsistency in field Clearing obligation
ECLR	Inconsistency in field Cleared
ECLT	Inconsistency in field Clearing timestamp
ECCP	Inconsistency in field CCP
EINT	Inconsistency in field Intragroup
EFX1	Inconsistency in field Fixed rate leg 1
EFX2	Inconsistency in field Fixed rate leg 2
EEXR	Inconsistency in field Exchange rate
EFER	Inconsistency in field Forward exchange rate
EERB	Inconsistency in field Exchange rate basis
ECMB	Inconsistency in field Commodity base
ECMD	Inconsistency in field Commodity details
EOTP	Inconsistency in field Option type
EOEX	Inconsistency in field Option exercise style
ESTP	Inconsistency in field Strike price (cap/floor rate)
ESPN	Inconsistency in field Strike price notation

EMTU	Inconsistency in field Maturity date of the underlying
ESNR	Inconsistency in field Seniority
EREN	Inconsistency in field Reference entity
EFOP	Inconsistency in field Frequency of payment
ESER	Inconsistency in field Series
EVER	Inconsistency in field Version
EINF	Inconsistency in field Index factor
ETRN	Inconsistency in field Tranche
EATP	Inconsistency in field Attachment point
EDTP	Inconsistency in field Detachment point