

Opis funkcjonalności KDPW_TR

Spis treści

SŁOWNIK POJĘĆ.....	2
UŻYTKOWNICY REPOZYTORIUM	3
DOSTĘP DO KDPW_TR	5
OBSŁUGA KOMUNIKATÓW	6
Budowa komunikatów XML	6
Przestrzenie nazw (namespaces)	6
Nagłówki	7
Zestaw znaków	7
Przepływ komunikatów pomiędzy Uczestnikami a Repozytorium	7
ZAKRES INFORMACJI PRZECHOWYWANYCH W KDPW_TR	14
Identyfikatory raportów i zgłoszeń w systemie TR.....	15
Kluczowe daty związane z procesem raportowania.....	16
Identyfikatory podmiotów stosowane w KDPW_TR.....	17
KONTROLA RODZAJÓW ZMIAN.....	20
RODZAJE ZMIAN.....	21
ZASADY REJESTROWANIA ZGŁOSZEŃ W POSZCZEGÓLNYCH RODZAJACH ZMIANY	21
AT=N (New)	22
AT=P (Position component).....	22
AT=M (Modify).....	22
AT=R (Correction)	24
AT=C (Early Termination).....	26
AT=Z (Compression).....	27
AT=V (Valuation and collateral update)	27
AT=E (Error).....	30
OBSŁUGA KOMUNIKATÓW PRZEPYTUJĄCYCH (TRAR.RQS).....	30
OBSŁUGA PROCESU PAROWANIA I PORÓWNYWANIA DANYCH.....	31
WERSJONOWANIE DANYCH.....	31

Słownik pojęć

Transakcja – zawarcie kontraktu w instrumentach pochodnych

Pozycja – powstaje w wyniku zawarcia jednej lub wielu transakcji w kontraktach pochodnych (opartych o ten sam instrument bazowy) pomiędzy tymi samymi kontrahentami

Raport – zgłoszenie zawarcia przez dwie strony transakcji lub powstania pozycji

Zgłoszenie – przesłanie do TR komunikatu o nowej transakcji/pozycji w kontraktach terminowych lub modyfikacji ich warunków;

AT- rodzaj zmiany komunikatu - pole z tabeli walidacyjnej ESMA

Wpis – zapis w bazie danych powstały na podstawie odebranego zgłoszenia; w praktyce oznacza to, że w systemie TR może być zarejestrowanych wiele wpisów dotyczących tego samego raportu (transakcji bądź pozycji)

EMIR RTS/ITS:

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 transakcji.

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.

Użytkownicy Repozytorium

Można wyróżnić następujące klasy podmiotów, których działanie jest rozróżnione poziomem ich uprawnień:

- 1) **Operator repozytorium** – pracownik KDPW_TR.
- 2) **Nadzorca (Supervisor)** - podmiot przewidziany w Rozporządzeniu Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) Nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. (art. 81 ust. 3), który posiada dostęp do danych zawartych w TR, nadany zgodnie z zasadami zawartymi w regulacjach. Nadzorcy posiadają nie tylko dostęp do danych transakcyjnych, ale także do raportów wynikających z regulacji i wymogów Komisji Europejskiej.
- 3) **Generalny uczestnik raportujący (GUR)** – podmiot uprawniony do raportowania w imieniu własnym lub w imieniu innego podmiotu, jako instytucja pośrednicząca (nie będąca stroną kontraktu); posiada uprawnienia do wprowadzania, modyfikowania, usuwania raportów, w których występuje, jako podmiot raportujący (działając w imieniu własnym lub innego podmiotu zawierającego kontrakt), jednocześnie ma możliwość przeglądania raportów, które zgłosił oraz raportów zgłoszonych przez innych raportujących, w których jest stroną; może wykorzystywać zarówno kanał WEB jak i kanał MQ.
- 4) **Zwykły uczestnik raportujący (ZUR)** – podmiot uprawniony do raportowania we własnym imieniu lub w imieniu kontrpartniera pod warunkiem, iż jest stroną kontraktu; 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.
- 5) **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.
- 6) **Pośredni uczestnik repozytorium (PUR)** – podmiot, który sam nie zgłasza danych o zawartych przez siebie kontraktach, ale jest zainteresowany przeglądaniem raportów i ewentualnym zgłaszaniem błędów w raportach, w których jest podmiotem zawierającym (stroną kontraktu); może wykorzystywać zarówno kanał WEB jak i kanał MQ;
- 7) **Komercyjny użytkownik repozytorium (KUR)** - podmiot, który za zgodą kontrahenta, będącego uczestnikiem repozytorium uzyskuje dostęp do raportów. Podmiot ten bez względu na relację z KDPW_TR oznaczony jest oddzielnym uprawnieniem KUR (czyli nie ma znaczenia, że ten podmiot może mieć już uprawnienie ZUR lub GUR). KUR jest identyfikowany przez TR w momencie rejestracji uprawnień. Korzysta z kanału Web i MQ.

Repozytorium zobowiązane jest do udostępnienia kontrahentom, rozumianym jako strony kontraktu (zgodnie z art. 80 EMIR), możliwości weryfikowania poprawności zarejestrowanych raportów. W praktyce oznacza to konieczność przyznania wszystkim chętnym podmiotom zidentyfikowanym przez uczestników zgłaszających, jako strony kontraktu, podglądu do danych ich dotyczących. Dostęp ten możliwy jest poprzez stronę WWW i kanałem A2A, i jest ograniczony wyłącznie do

raportów, w których dana instytucja występuje, jako kontrpartner. Taki dostęp przewidziany jest dla PUR - stron kontraktu. W przypadku uczestników pośrednich przeglądanie informacji o zaraportowanych transakcjach i pozycjach jest w rzeczywistości jedyną możliwą aktywnością w ramach KDPW_TR.

Dostęp do KDPW_TR

Podstawową funkcją repozytorium transakcji jest rejestracja zgłoszeń transakcji i pozycji. Rejestracja dokonywana jest na podstawie zdefiniowanych komunikatów przesyłanych do repozytorium transakcji przez uczestnika raportującego, przy czym komunikaty te mogą być przekazywane przy wykorzystaniu:

1. **Interfejsu graficznego** - interfejs użytkownika, wspierający manualną wymianę danych z aplikacją KDPW_TR. Zrealizowany na bazie aplikacji dostępnej w ramach witryny internetowej www.kdpw.pl. Interfejs jest udostępniony w sieci Internet.

Warunkiem uzyskania dostępu do Repozytorium Transakcji EMIR jest założenie konta w aplikacji KDPW poprzez system Single Sign-On (SSO), a następnie złożenie wniosku dostępowego. Instrukcja obsługi SSO dla uczestników Repozytorium Transakcji dostępna jest na stronie internetowej, w zakładce Aplikacja.

oraz

2. **Kanału A2A** (Application to Application) wspierającego automatyczną wymianę danych pomiędzy aplikacją KDPW_TR po stronie KDPW i aplikacjami Uczestników KDPW_TR. Zrealizowany na bazie wymiany zdefiniowanych komunikatów XML za pomocą oprogramowania IBM WebSphere MQ. Kanał A2A jest udostępniony w sieci Internet, z wykorzystaniem bezpiecznego tunelu VPN (VPN concentrator lub router komunikacyjny) oraz w ramach sieci Extranet, zbudowanej na bazie kanałów cyfrowych operatorów Polpak i Exatel. Parametry konfiguracyjne kanału komunikacyjnego oraz nazwa kolejki MQ, kanału komunikacji MQ są udostępnione na stronie internetowej. Dalsze szczegóły, profil dostępowy oraz hasło zostają przekazane zainteresowanym użytkownikom po wystąpieniu o udostępnienie środowiska w trybie A2A i po pobraniu certyfikatu elektronicznego, który służy do uwierzytelnienia kanału komunikacyjnego, zestawianego w oparciu o wyposażenie telekomunikacyjne. W ramach interfejsu obsługiwane jest oprogramowanie w IBM WebSphere MQ w wersji Client i w wersji Server. KDPW nie pośredniczy w dystrybucji tego oprogramowania.

Komunikaty związane z rejestracją informacji w KDPW_TR są zbudowane w oparciu o zakres informacyjny określony przez regulatorów. Zawierają one zestaw danych wymaganych przez Repozytorium do właściwego identyfikowania transakcji/pozycji oraz właściwej obsługi procesów rejestracji. Komunikat wchodzący do systemu KDPW_TR (niezależnie od rodzaju zmiany w nim zadeklarowanego) posiada jednolitą strukturę, przy czym opracowane zostały również uproszczone komunikaty zbiorcze pozwalające na alternatywną obsługę konkretnych rodzajów zmian. Zakres wymaganych i przetwarzanych danych jest uzależniony od typu rejestracji i został opisany w dalszej części materiału.

W przypadku raportowania za pośrednictwem komunikatów XML, istnieje możliwość zgłaszania wielu raportów za pośrednictwem jednego pliku. Wówczas w komunikatach zwrotnych znajdować się będzie informacja o statusie przetworzenia każdego z raportów, a w przypadku błędu podany zostanie również kod tego błędu. W przypadku użycia formularza graficznego, komunikaty zwrotne kierowane są do dedykowanego folderu (zakładka 'TR Communication'), gdzie można je pobrać w formacie *.xml. W ramach tej funkcjonalności obsługiwane są również przypadki informowania uczestnika raportującego o anulowaniu raportu przez drugiego kontrahenta (AT=E) oraz o rozbieżności wykrytej w procesie rekonyliacji.

Obsługa komunikatów

Budowa komunikatów XML

Nazewnictwo komunikatów KDPW_TR opiera się na zaleceniach normy ISO20022:

Nazwa komunikatu posiada następującą postać:

yyyy.aaa.bbb.xx

gdzie:

yyyy - prefix komunikatów:

trar – przedrostek komunikatów wykorzystywanych przez system TR;

admi – komunikat wystąpienia błędu formalnego;

aaa — rodzaj komunikatu związany z jego funkcją:

ins- zgłoszenie;

rqs – zapytanie;

sts – odpowiedź;

rcn – rekoncyliacja;

err – komunikat wystąpienia błędu formalnego;

ntf – notyfikacja.

bbb — kod określający wariant funkcji komunikatu – numeryczny;

xx — wersja komunikatu w postaci numerycznej.

Nazwy i struktury powołanych komunikatów XML zostały zamieszczone na witrynie KDPW.

Przestrzenie nazw (namespaces)

W komunikatach KDPW_TR wykorzystywane są cztery przestrzenie nazw:

- Domyślna przestrzeń nazw (defaultnamespace)

Jej nazwa składa się z części stałej w postaci:

urn:std:kdpw:

oraz części zmiennej zbudowanej według schematu:

xsd:IdentyfikatorKomunikatu

(np.: urn:std:kdpw:xsd:trar.ins.001.02)

- xs: standardowa przestrzeń nazw dla W3C XML schema
- xsi: standardowa przestrzeń nazw dla W3C XML schemainstance
- docelowa przestrzeń nazw (target namespace) — taka sama jak przestrzeń domyślna

Nagłówki

Pierwszy element każdego komunikatu posiada zawsze nazwę: **<KDPWDocument>**. Element ten zawiera następujące obowiązkowe atrybuty:

Sndr (sender) — nadawca komunikatu w postaci kodu uczestnika KDPW_TR lub kodu KDPW_TR (R001);

Rcvr (receiver) — odbiorca komunikatu w postaci kodu uczestnika KDPW_TR lub kodu KDPW_TR (R001).

Drugi element (bezpośredni potomek elementu głównego) posiada zawsze nazwę tożsamą z nazwą komunikatu.

Przykład:

```
<KDPWDocumentSndr="kod wystawcy" Rcvr="R001"
  xmlns="urn:std:kdpw:xsd: yyyy.aaa.bbb.xx"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"

  <yyyy.aaa.bbb.xx>
    <GnlInf>
      ...
    </GnlInf>
    ...
  </yyyy.aaa.bbb.xx>
</KDPWDocument>
```

Zestaw znaków

Komunikaty KDPW_TR wykorzystują zestaw kodowania znaków UTF-8.

Przepływ komunikatów pomiędzy Uczestnikami a Repozytorium

W ramach obsługi rynku przez KDPW_TR wykorzystywane są następujące typy komunikatów:

- 1) Komunikat zakładania relacji między podmiotem raportującym a stroną transakcji - trar.rlt.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu) – dot. tylko uczestników w typie GUR i ZUR - obowiązuje od 10.04.2021 (szczegóły w rozdziale Zakres informacji przechowywany w KDPW_TR),

- 2) Komunikat potwierdzający stan relacji – trar.str.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu) – dot. tylko uczestników w typie GUR i ZUR - obowiązuje od 10.04.2021 (szczegóły w rozdziale Zakres informacji przechowywany w KDPW_TR),
- 3) komunikat zgłoszenia do systemu KDPW_TR - trar.ins.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 1) raportowanie wyceny - trar.ins.002.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 2) notyfikacja - trar.ntf.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 3) komunikat przyjęcia komunikatu do systemu KDPW_TR po kontroli formalnej (zwrotny I stopnia) – trar.ack.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu)
- 4) komunikat błędu formalnego – admi.err.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu)
- 5) komunikat ze statusem zgłoszenia do systemu KDPW_TR po kontroli merytorycznej dla komunikatu podstawowego (zwrotny II stopnia) - trar.sts.003.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 6) komunikat ze statusem zgłoszenia do systemu KDPW_TR po kontroli merytorycznej dla komunikatu zbiorczego oraz komunikatu przepytującego (zwrotny II stopnia) - trar.sts.002.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 7) komunikat ze statusem przetworzenia zgłoszenia do systemu KDPW_TR po kontroli merytorycznej dla komunikatu zbiorczego oraz komunikatu przepytującego (zwrotny III stopnia) - trar.sts.002.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 8) komunikat potwierdzający przetworzenie i zapis w systemie KDPW_TR (zwrotny III stopnia) - trar.sts.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 9) komunikat zgłoszenia przepytującego - trar.rqs.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu),
- 10) komunikat informujący o nieskutecznym parowaniu lub porównaniu raportów - trar.rcn.001.xx (gdzie xx to aktualna wersja komunikatu).

Do KDPW_TR przekazywane są (za pomocą komunikatów trar.ins.xxx.xx) zgłoszenia zawarcia transakcji lub powstania pozycji oraz pozostałe wpisy związane z modyfikacją tych zgłoszeń. Każdy przyjęty komunikat jest przetwarzany w systemie i na każdym poziomie jego przetwarzania wysyłana jest do nadawcy odpowiedź z informacją (o ile uczestnik wyraził taką potrzebę w deklaracji uczestnika).

Poziom I – kontrola formalna

W przypadku błędu formalnego będzie to komunikat admi.err.001.xx (uczestnik otrzymuje niezależnie od deklaracji), ze wskazaniem kodu i opisu błędu oraz wskazaniem miejsca błędu. Do błędów formalnych zaliczamy następujące rodzaje błędów:

- komunikat niezgodny ze schemą XSD
- nadawca niezgodny z nadawcą podanym w komunikacie w polu Report submitting entity ID (tag RptgNtty) lub w przypadku pozostawienia tego pola pustego, z kontrahentem raportującym podanym w komunikacie w polu Counterparty – Identification (tag RptgCtrPtyId).

W odpowiedzi na przesłany komunikat, w którym nie wykryto błędów formalnych, system zwrotnie wygeneruje jeden komunikat trar.ack.001.xx potwierdzający odebranie komunikatu oraz pozytywne przejście kontroli formalnej bez względu na ilość transakcji przekazanych w tym komunikacie.

Poziom II – kontrola merytoryczna

Informacja o wyniku kontroli merytorycznej przekazywana jest komunikatem trar.sts.003.xx z odpowiednim statusem (PACK – w przypadku poprawnego komunikatu, ERRO – w przypadku błędu). W przypadku, gdy uczestnik w deklaracji nie wyraził potrzeby otrzymywania tego komunikatu, to system KDPW_TR działa w ten sposób, że pomimo iż komunikat ten nie jest skonfigurowany to wysyła go do transakcji ze statusem ERRO, czyli w przypadku błędu, tak aby uczestnik wiedział, że transakcje nie przeszły kontroli merytorycznej, zaś dla przypadków prawidłowych tj. ze statusem PACK, system nie wysyła trar.ins.003.xxx.

Poziom III – zapis w bazie danych KDPW TR

Po przetworzeniu raportu i zapisaniu danych w bazie danych KDPW_TR, do uczestnika raportującego wysyłany jest komunikat potwierdzający dane zapisane w bazie KDPW_TR na podstawie przesłanego raportu (trar.sts.001.xx, status PACK).

Ponadto do uczestników wysyłane są komunikaty notyfikacyjne, generowane z systemu KDPW_TR w następujących przypadkach:

trar.rcn.001.xx

- komunikat informuje o wynikach rekonyliacji, W komunikacie trar.rcn.001.xx zobaczysz wówczas statusy parowania i porównania raportów oraz rozbieżności – czyli powtarzalną sekcję [1..n] dotyczącą wszystkich przyczyn oraz opisów przyczyn, dla każdej rozbieżności, która wystąpiła w wyniku porównania raportów. Dodatkowo, w przypadku wystąpienia rozbieżności podawane są również wartości przekazane w tym polu przez uczestników, przy czym obydwaj raportujący otrzymują wartość podaną przez siebie jak i wartość podaną przez drugą stronę.

trar.ntf.001.xx, otrzymasz w 2 przypadkach:

w przypadku AT=T (techniczny) - komunikat trar.ntf.001.xx informuje o wygaszeniu raportu w dacie jej zapadalności W otrzymanym komunikacie trar.ntf.001.xx będzie wówczas, że Eligibility date =Maturity Date oraz klucz transakcji, której komunikat dotyczy; ww. komunikat techniczny AT=T, system wysyła na początku dnia określonego datą Maturity Date.

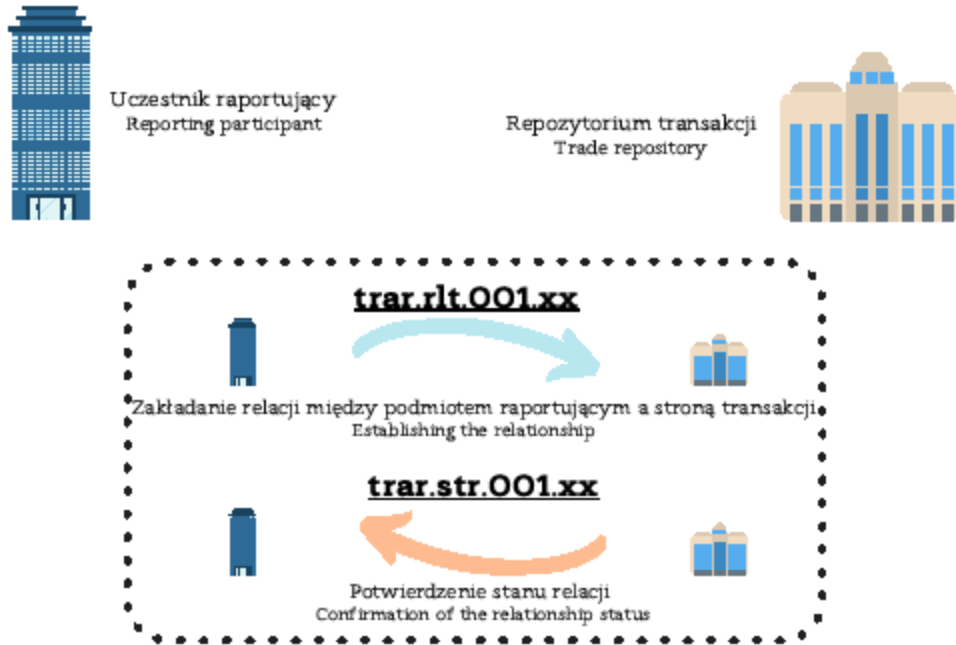
w przypadku wysłania przez drugą stronę AT=E (pod warunkiem, że druga strona raportuje do KDPW_TR)- komunikat trar.ntf.001.xx informuje o anulowaniu (AT=E) raportu przez drugiego kontrahenta. W otrzymanym komunikacie trar.ntf.001.xx będzie wówczas, że Eligibility date =dacie wysłania AT=E przez drugą stronę, klucz transakcji, do której zostało wysłane AT=E oraz kod odpowiedzi <RsnCd> **1253**</RsnCd>, <RsnTxt>Trade annulled (AT=E) by the other counterparty.</RsnTxt>, który mówi, że transakcja została anulowana przez drugiego kontrahenta.

Wszystkie komunikaty wchodzące do KDPW_TR, są niezwłocznie przyjmowane, a komunikaty zwrotne kierowane są w ten sam kanał, którym zostały przekazane.

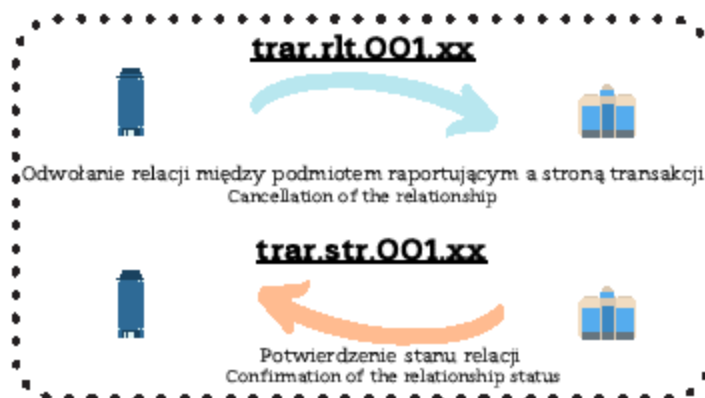
Wszystkie komunikaty, bez względu na kanał wejścia (interfejs graficzny WWW, czy też interfejs A2A) obsługiwane są zgodnie z zasadą FIFO [first in first out]. System TR przetwarza komunikaty w kolejności ich przekazania. Oznacza to, że możliwe będzie przekazanie dwóch kolejnych komunikatów dotyczących tego samego raportu (np. rejestracja AT=N i kompresja AT=Z) bez oczekiwania na potwierdzenie przetworzenia pierwszego z nich. Zgodnie z tą zasadą nigdy nie dojdzie do sytuacji, gdy system KDPW_TR zarejestruje kompresję przed przetworzeniem komunikatu rejestrującego zawarcie transakcji, jeśli zawarcie zostało zgłoszone przed kompresją.

Prezentowane poniżej diagramy opisują przepływy komunikatów w KDPW_TR:

Zgłoszenie relacji Report of the relationship

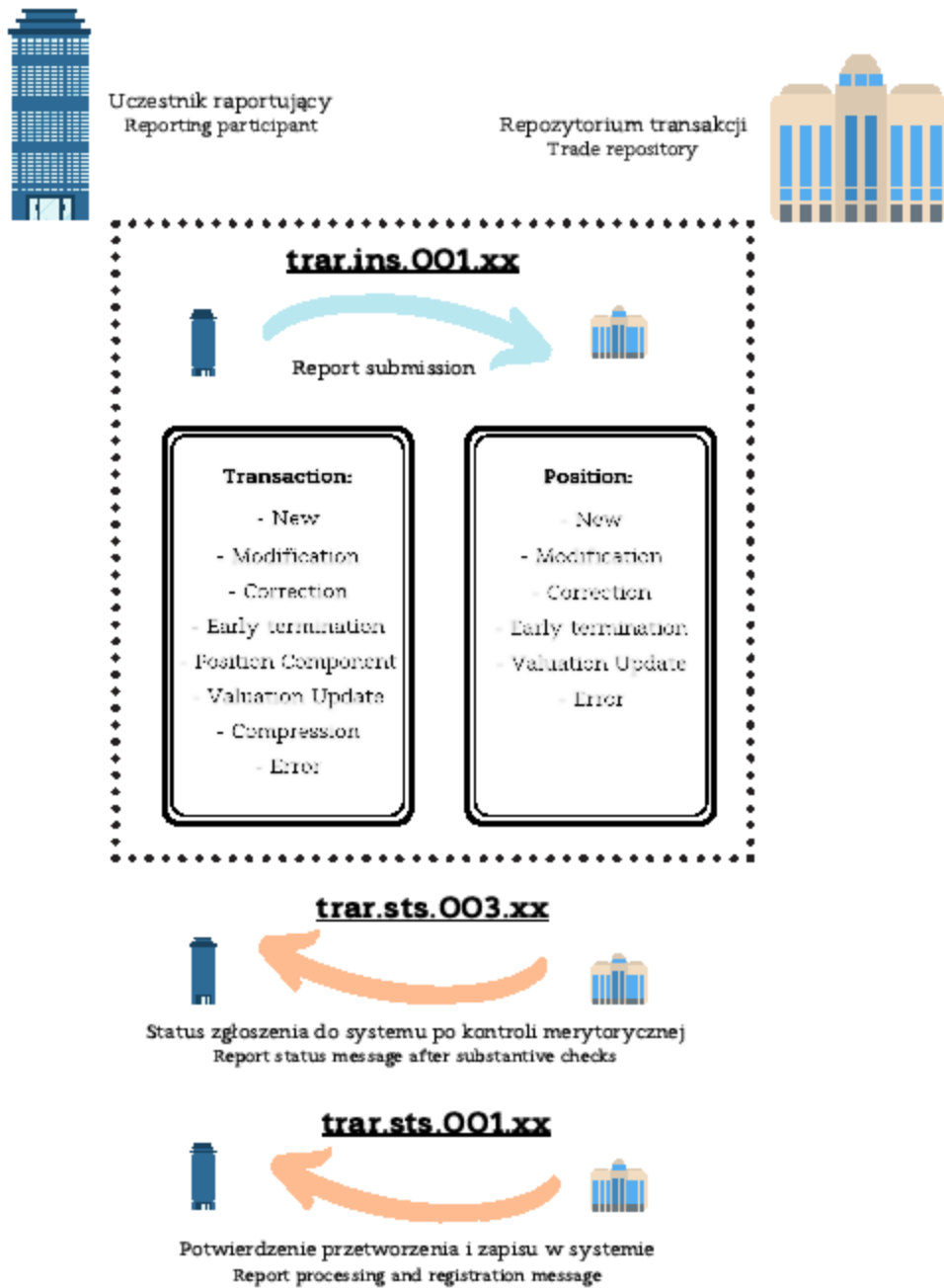


Odwołanie relacji Cancellation of the relationship



xx - wersja komunikatu w postaci numerycznej
message version in a numerical form

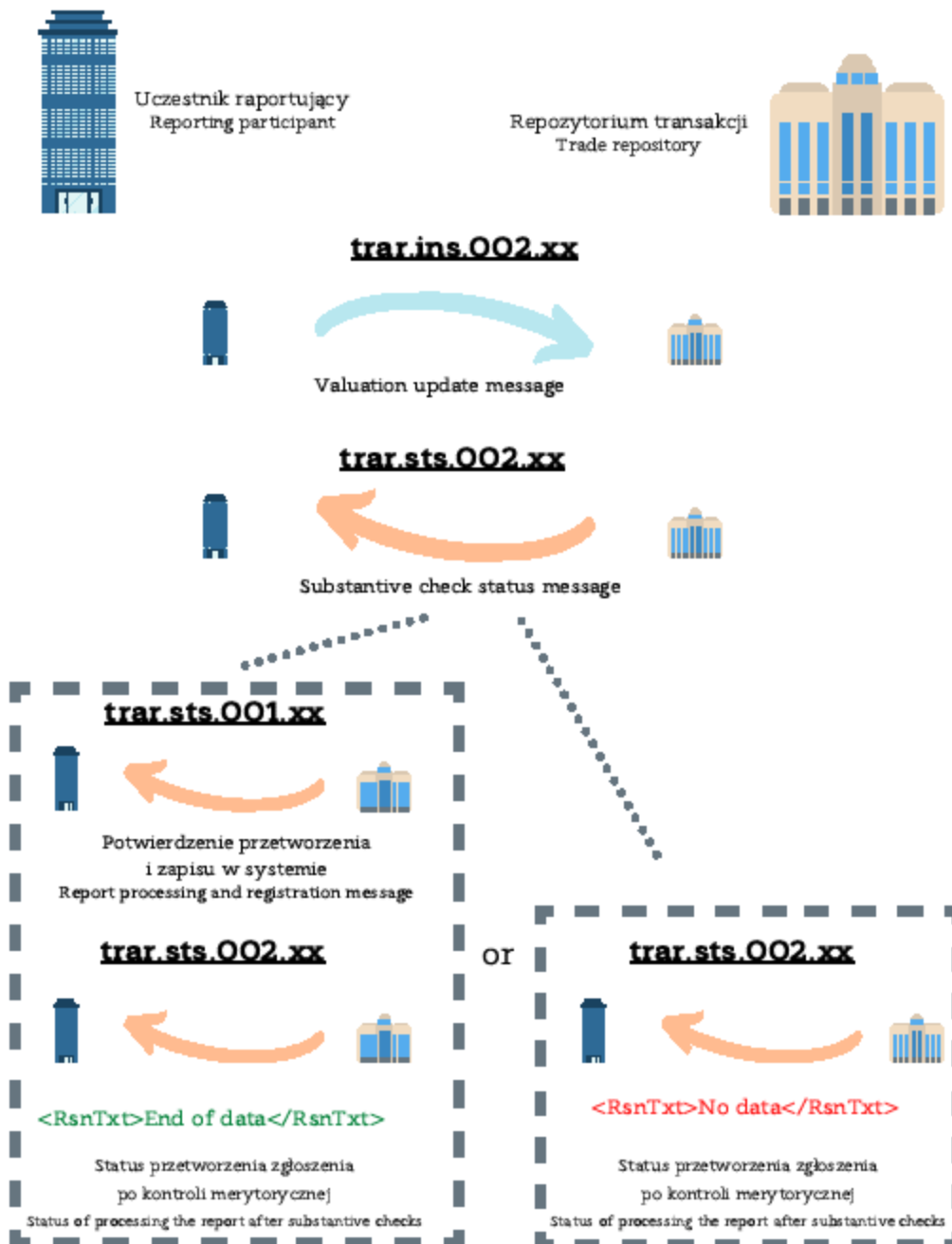
Komunikaty zwrotne po kontroli merytorycznej
Feedback messages after substantive checks



Obsługa zapytań o status zarejestrowanej transakcji Handling status queries



Zbiorcze komunikaty zgłoszenia Summary reports



Zakres informacji przechowywanych w KDPW_TR

- I. Komunikat (trar.rlt.001.xx) - Zakładanie relacji między podmiotem raportującym a stroną transakcji – dotyczy tylko uczestników w typie GUR i ZUR

Bez wcześniejszego zaraportowania relacji, tj. wskazania kodu LEI podmiotu, który delegował raportowanie na RSE (Report Submitting Entity), nie jest możliwe raportowanie w imieniu innych podmiotów.

Z uwagi na brak w obecnych RTS pola, w którym RSE mógłby wskazać podmiot zobligowany do raportowania (np. FC za NFC minus), konieczność przesłania komunikatu trar.rlt.001.01 obejmuje wszystkie podmioty raportujące wskazujące w polu Reporting Counterparty inny niż własny LEI.

- przesłane relacje poprzez komunikat trar.rlt.001.01 dotyczą rodzajów zmian **AT: N, M, R, Z, V i P, natomiast nie dotyczą AT: C i E;**
- weryfikacja kodów LEI podanych w komunikacie trar.rlt.001.01 jest w oparciu o bazę GLEIF – badanie dotyczy kodu zamieszczonego w tag-u RclId (LEI Reporting counterparty) oraz w tag-u RptgNtty (LEI RSE);
- w przypadku sekcji New, dopuszczalne statusy rejestracji kodu to: ISSUED, PENDING_TRANSFER, PENDING_ARCHIVAL;
- w przypadku sekcji Cxl (Usunięcie relacji), status rejestracji kodu może być dowolny.;
- po każdym wysłaniu komunikatu trar.rlt.001.01 uczestnik każdorazowo otrzymuje odpowiedź – komunikat trar.str.001.01 i dodatkowo, na koniec dnia, tzw. zbiorczy trar.str.001.01 będący zestawieniem wszystkich aktywnych relacji, aby uczestnik mógł zweryfikować bieżący (na koniec dnia) stan relacji;
- każdorazową odpowiedź –trar.str.001.01 i tzw. zbiorczy trar.str.001.01 będący zestawieniem wszystkich aktywnych relacji można rozróżnić po wartości przekazanej w tagu<RltdSndrMsgRef>;
- komunikaty trar.str.001.01, które KDPW_TR EMIR odsyła po każdym trar.rlt.001.01 – są odsyłane tym samym kanałem, którym zostały przesłane trar.rlt.001.01, natomiast tzw. zbiorczy trar.str.001.01, będący zestawieniem wszystkich aktywnych relacji, przesłany pod koniec dnia przez KDPW_TR EMIR może być odesłany tylko i wyłącznie jednym kanałem, dlatego każdy uczestnik KDPW_TR EMIR musi zadeklarować odpowiedni kanał (U2A lub A2A) poprzez przesłanie odpowiedniej deklaracji.
- Zmiana kanału jest możliwa w każdym momencie, poprzez ponowne wypełnienie i przekazanie do KDPW nowej deklaracji.

- II. Komunikat zgłoszenia do KDPW_TR składa się z sekcji:

1. **‘General information’** (informacje ogólne), zawierającej identyfikator zgłoszenia (SMR) oraz kod raportującego (wymagany, o ile jest różny od kodu kontrahenta).
2. **‘Report’** (raport), która zawiera dane zgodne z wymogami regulacyjnymi, tj. EMIR RTS/ITS. Sekcja ‘Report’ zawiera dwie podsekcje: ‘Transaction’ (transakcja) oraz ‘Position’ (pozycja), które z kolei składają się z podsekcji wskazujących dane wymagane w poszczególnych rodzajach zmian (AT).

Możliwe jest przekazanie komunikatu zgłoszenia za obydwie strony jednocześnie – konstrukcja komunikatu wymaga w takich przypadkach dwukrotnego przekazania danych z podsekcji Counterparty (CtrPty) oraz ewentualnie Valuation (Valtn) lub Collateral (Coll) w podsekcji odpowiadającej danemu rodzajowi zmiany (AT) oraz jednokrotnego przekazania danych z sekcji CommonTradeData (CmonTradData). Na podstawie takiego zgłoszenia, w bazie danych KDPW_TR zakładane są dwa nowe wpisy z informacjami odpowiadającymi przekazanym danym, za każdą ze stron odrębnie. W przypadku raportowania za jedną ze stron, dane wszystkich sekcji powinny być wypełnione jednokrotnie, a weryfikacja istnienia raportu złożonego przez drugą stronę kontraktu przeprowadzona zostaje w odrębnym procesie parowania i porównywania raportów (tzw. proces rekonyliacji), który jest opisany w odrębnym dokumencie – *‘Opis procesu rekonyliacji’* – udostępnianym na stronie internetowej KDPW_TR.

W przypadku raportu dwustronnego, każda ze stron kontraktu ma dostęp do informacji zapisanych w jednym raporcie, w którym występuje jako kontrahent (Reporting Counterparty ID), natomiast nie widzi raportu zgłoszonego za drugą stronę kontraktu, tj. do tego w której występuje jako drugi kontrahent (ID of the Other Counterparty). Jedynie podmiot raportujący ma dostęp do informacji w obu zgłoszonych przez siebie raportach.

Identyfikatory raportów i zgłoszeń w systemie TR

Podstawowe identyfikatory raportu i zgłoszenia z punktu widzenia Uczestnika KDPW_TR to:

- Identyfikator zgłoszenia nadawany przez raportującego – Sender Message Reference (SMR),
- Identyfikator transakcji/pozycji – Unique Trade Identifier (UnqTradIdr),
- Identyfikator podmiotu raportującego – Reporting Counterparty ID (RptgCtrPtyId),
- Identyfikator drugiego kontrahenta – ID of the Other Counterparty (OthrCtrPty).

Powyższe identyfikatory (z wyłączeniem SMR) to klucze, czyli pola, których modyfikacje (zmiany) są niedopuszczalne zwykłym komunikatem zgłoszenia dla żadnego z użytkowników systemu KDPW_TR. Zgłoszenie zmiany UTI odbywa się poprzez anulację raportu (AT=E) i ponowne przesłanie zgłoszenia (AT=N) z nowym UTI oraz pozostałych zgłoszeń, jeśli jest taka konieczność.

Identyfikatory nadawane przez raportującego:

Identyfikator zgłoszenia nadawany przez raportującego - Sender Message Reference (SMR)

SMR służy raportującemu, jako identyfikator zapisu w historii danego raportu. KDPW_TR nie kontroluje unikalności tego identyfikatora.

Kod reprezentowany jest poprzez 16 znakowe pole alfanumeryczne.

Identyfikator transakcji/pozycji - UniqueTradeIdentifier (UnqTradIdr)

Unikalny identyfikator (UTI) uzgadniany przez obie strony kontraktu, zgodnie z dokumentem ESMA ‘Question and Answer’ (TR question/answer 18 i 19). TR kontroluje unikalność tego identyfikatora w obrębie klucza transakcji/pozycji (w którego skład wchodzi TID i identyfikatory stron). Użycie tego

samego UTI (UnqTradIdr) pomiędzy tymi samymi stronami kontraktu możliwe jest tylko raz. Próba ponownego użycia tego samego UnqTradIdr pomiędzy tymi samymi stronami kontraktu, skutkuje odrzuceniem komunikatu, nawet jeśli poprzedni raport został całkowicie anulowany (tzn. przesłano AT=E anulujące całą transakcję). W trakcie modyfikacji kontraktu identyfikator ten zawsze pozostaje niezmienny.

Kod reprezentowany jest poprzez 52 znakowe pole alfanumeryczne.

Identyfikator kontrahenta – Reporting Counterparty ID (RptgCtrPtyId)

Unikalny identyfikator kontrahenta, tj. 20 znakowy alfanumeryczny kod LEI.

Identyfikator drugiego kontrahenta – ID of the Other Counterparty (OthrCtrPty)

Unikalny identyfikator drugiego kontrahenta, tj. 20 znakowy alfanumeryczny kod LEI, bądź w przypadku podmiotów niezobowiązanych do raportowania zgodnie z Art. 9 Rozporządzenia EMIR, 50 znakowy alfanumeryczny kod klienta.

Kluczowe daty związane z procesem raportowania

W procesie raportowania istotne są następujące daty:

- **'Reporting timestamp'** (czas zaraportowania) – data i czas przekazania zgłoszenia przez uczestnika raportującego do KDPW_TR (format zgodnie z ISO 8601: YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ)

Zgodnie z tabelą walidacyjną znacznik czasu (timestamp) przekazany w polu Reporting timestamp powinien być równy lub wcześniejszy od znacznika czasu wskazującego moment przyjęcia raportu/zgłoszenia do systemu KDPW_TR. Jednocześnie data w polu Reporting timestamp nie może być wcześniejsza niż dzień poprzedzający datę otrzymania raportu przez KDPW_TR, tj. dla każdego AT muszą być spełnione jednocześnie dwa warunki:

Reporting timestamp' <= czas przyjęcia raportu do system KDPW_TR (ReceivedDtTm)

Reporting timestamp' > data przyjęcia raportu do system KDPW_TR (ReceivedDt) minus 2 dni

Dodatkowo pole Reporting timestamp powinno być równe lub większe od daty wprowadzonej w polu Execution timestamp:

Reporting timestamp >= Execution Timestamp

- **'Valuation timestamp'** – data i czas wyceny;
- **'Execution timestamp'** – data i czas zawarcia transakcji;
- **'Effective date'** – data wejścia w życie obowiązków wynikających z kontraktu;
- **'Maturity date'** – data zapadalności/wygaśnięcia zgłaszanego kontraktu; w polu tym nie zgłasza się wcześniejszego rozwiązania kontraktu;
- **'Termination date'**- data wcześniejszego rozwiązania zgłaszanego kontraktu;

- **'Eligibility date'** – data obowiązywania zapisu dotyczącego transakcji/pozycji (pole niewyszczególnione w standardach technicznych); data określająca, od którego dnia obowiązują dane zawarte w przesłanym do systemu KDPW_TR zgłoszeniu;
 - dla AT=N (level P) **Eligibility date** obowiązkowe;
 - dla AT=N, AT=P (level T) **Eligibility date** =ExecutionTimestamp;
 - dla AT=M, AT=R i AT=V (zabezpieczenia) **Eligibility date** obowiązkowe;
 - dla AT=V (wycena) **Eligibility date** =Valuation Timestamp;
 - dla AT=C, AT=Z **Eligibility date** =Termination Date
- **'Settlement date'** – data rozrachunku instrumentu bazowego; w raporcie istnieje możliwość przekazania dowolnej liczby dat rozrachunku zdefiniowanych w kontrakcie; każda z tych dat zachowana zostaje w bazie danych KDPW_TR.

Dla poniższych pól określających daty zdarzeń dotyczących zaraportowanego kontraktu musi być spełniony warunek: Date >='2014-02-12':

- 1.1. Reporting timestamp
- 1.19 Valuation timestamp
- 2.27 Maturity Date
- 2.28 Termination Date
- 2.29 Settlement Date
- 2.82 Maturity date of the underlying.

Identyfikatory podmiotów stosowane w KDPW_TR

- Kod wystawcy komunikatu
- Kod odbiorcy komunikatu
- Kod identyfikacyjny podmiotu raportującego (Report submitting entity ID)
- Kod identyfikacyjny kontrahenta (Reporting Counterparty ID)
- Kod identyfikacyjny drugiego kontrahenta (ID of the other counterparty)
- Kod identyfikacyjny maklera (Broker ID)
- Kod identyfikacyjny członka rozliczającego (Clearing member ID)
- Kod identyfikacyjny beneficjenta (Beneficiary ID)

Kod wystawcy komunikatu

Kod wystawcy komunikatu – komunikacyjny, 4 znakowy alfanumeryczny kod podmiotu raportującego, wykorzystywany do właściwej adresacji przesyłki zgodnie z przyjętymi zasadami obsługi komunikatów w KDPW. W przypadku komunikatów przekazywanych od uczestników raportujących bezpośrednio kanałem MQ jest to kod skojarzony z wydanym certyfikatem. W komunikatach wysyłanych z TR do uczestników raportujących umieszczany jest kod identyfikujący Repozytorium (R001).

Kod odbiorcy komunikatu

Kod odbiorcy komunikatu – komunikacyjny, 4 znakowy alfanumeryczny kod, wykorzystywany do właściwej adresacji przesyłki zgodnie z przyjętymi zasadami obsługi komunikatów w KDPW. W przypadku komunikatów przekazywanych do TR pole powinno zawierać kod Repozytorium (R001). W komunikatach wysyłanych z TR do uczestników raportujących umieszczany jest komunikacyjny kod identyfikujący uczestnika raportującego.

Kod identyfikacyjny podmiotu raportującego (Identyfikator TR wystawcy komunikatu – Report Submitting Entity ID).

Podmiot raportujący musi być zarejestrowany w bazach TR w jednym z dostępnych typów uczestnictwa. Podczas konfiguracji uczestnika raportującego w systemie podawany jest kod LEI, który jest polem obowiązkowym i jedynym dopuszczalnym identyfikatorem w każdym komunikacie przesyłanym przez uczestnika. Jest to 20 znakowy kod alfanumeryczny.

Na podstawie tego kodu, w złożeniu z kodem kontrahenta (Reporting Counterparty ID) przeprowadzana jest weryfikacja uprawnień związanych z przekazywaniem zgłoszeń do Repozytorium. Jeśli zgłoszenie wysyłane jest we własnym imieniu (GUR, IUR lub ZUR) pole to powinno być puste.

Kod identyfikacyjny kontrahenta (Reporting Counterparty ID)

Niepowtarzalny kod identyfikujący kontrahenta będącego stroną kontraktu, zgodny z RTS/ ITS (20 znakowy alfanumeryczny kod LEI). Pole to określa stronę kontraktu. Identyfikator ten wchodzi w skład klucza transakcji/pozycji (wraz z identyfikatorem drugiego kontrahenta i numerem UTI). Zawartość pola nie może być modyfikowana w trakcie obowiązywania kontraktu – od jego zgłoszenia do wygaśnięcia/terminacji. Wyjątkiem jest zmiana identyfikatora stosowanego tymczasowo do oznaczenia strony kontraktu na kod LEI*

Kod LEI musi być ważny tj. musi posiadać odpowiedni status. Statusy dopuszczalne dla AT: N, M, R, Z, V i P to "Issued", "Pending transfer" oraz "Pending archival". W przypadku AT=C kod LEI może posiadać dodatkowo status: "Lapsed" i „Retired”, zaś dla AT=E status jest ignorowany.

Kod identyfikacyjny drugiego kontrahenta (ID of the Other counterparty)

Niepowtarzalny kod identyfikujący drugiego kontrahenta kontraktu, zgodny z RTS/ITS (kod LEI lub kod klienta – dopuszczony w przypadku osób fizycznych nieprowadzących działalności gospodarczej). Pole to określa drugą stronę kontraktu. Pole wchodzi w skład klucza transakcji/pozycji (wraz z identyfikatorem kontrahenta i numerem UTI). Zawartość pola nie może być modyfikowana w trakcie obowiązywania kontraktu – od jego zgłoszenia do wygaśnięcia/terminacji. Wyjątkiem jest zmiana identyfikatora stosowanego tymczasowo do oznaczenia strony kontraktu, na kod LEI*.

Kod LEI musi być ważny tj. musi posiadać odpowiedni status. Statusy dopuszczalne dla AT: N, M, R, Z, V i P to "Issued", "Pending transfer" oraz "Pending archival". W przypadku AT=C kod LEI może posiadać dodatkowo status „Retired”, zaś dla AT=E status jest ignorowany.

*Zgodnie z Q&A TR Q40, w przypadków zamiany kodu Client Code na kod LEI, zmiana następuje tylko i wyłącznie na stronach transakcji, czyli jest stosowana jedynie do pól: *Reporting Counterparty ID* oraz *ID of the other counterparty*. Operacja ta nie zmienia kodów w pozostałych polach raportów (*Broker ID, Reporting entity ID, Clearing member ID, Beneficiary Id, CCP ID, Underlying*), niemniej jednak umożliwia wprowadzenie korekt (AT=R) do tych raportów.

Natomiast dla przypadków fuzji lub przejęcia podmiotu, zamiana kodu LEI na kod LEI obejmuje wszystkie pola (identyfikatory podmiotu), w których dany kod LEI występuje i dotyczy wszystkich uczestników raportujących, nie tylko uczestnika zmieniającego kod LEI.

Kod identyfikacyjny maklera (Broker ID)

Jeżeli makler działa jako pośrednik kontrahenta dokonującego zgłoszenia, nie stając się przy tym kontrahentem, kontrahent dokonujący zgłoszenia określa tego maklera za pomocą niepowtarzalnego kodu w polu BrokerId.

Kod ten nie podlega uzgodnieniu z drugą stroną kontraktu, jest wykorzystywany jedynie jako charakterystyka kontraktu. Zawartość pola może być modyfikowana w trakcie obowiązywania kontraktu – od jego zawarcia do wygaśnięcia/ terminacji.

Poprawny kod identyfikujący maklera to kod LEI.

Kod identyfikacyjny członka rozliczającego (Clearing member ID)

Jeżeli kontrahent dokonujący zgłoszenia nie jest członkiem rozliczającym, w tym polu wskazuje się niepowtarzalny kod członka rozliczającego transakcję.

Kod ten nie podlega uzgodnieniu z drugą stroną kontraktu, wykorzystywany jest jedynie jako charakterystyka kontraktu. Zawartość pola może być modyfikowana w trakcie obowiązywania kontraktu – od jego zgłoszenia do wygaśnięcia/ terminacji.

Poprawny kod identyfikujący członka rozliczającego to kod LEI.

Kod identyfikacyjny beneficjenta (Beneficiary ID)

Strona będąca podmiotem praw i obowiązków wynikających z kontraktu raportowana jest w polu Bnfcryld. Kod ten nie podlega uzgodnieniu z drugą stroną kontraktu, wykorzystywany jest jedynie jako charakterystyka kontraktu. Zawartość pola może być modyfikowana w trakcie obowiązywania kontraktu – od jego zawarcia do wygaśnięcia/ terminacji.

Kontrola rodzajów zmian

Każde zgłoszenie przesłane do KDPW_TR, które poprawnie przejdzie wszystkie kontrole, skutkuje powstaniem w bazie danych KDPW_TR wpisu (mutacji): jednego (w przypadku zgłoszeń jednostronnych) lub dwóch (w przypadku zgłoszeń dwustronnych). Każdy nowy wpis transakcji/pozycji w bazie KDPW_TR otrzymuje unikalny identyfikator raportu oraz przyporządkowaną datę obowiązywania.

Informacje o raportach dostępne są w interfejsie w 3 zakładkach, z podziałem odpowiadającym ich statusowi:

- ‘Active reports’ - prezentuje raporty aktywne
- ‘Non-active reports’ - prezentuje raporty nieaktywne
- ‘Deleted reports’ - prezentuje raporty anulowane

Zakres danych prezentowanych w zakładce ‘Deleted reports’ ograniczony jest do klucza raportu, czyli pól: UTI, Reporting Counterparty ID, Other Counterparty ID.

Rodzaje zmian

Każdy rodzaj zmian (AT) upoważnia do zarejestrowania ściśle określonych zmian/informacji. Obowiązujące kontrole merytoryczne wynikają wprost z tabeli walidacyjnej opublikowanej przez ESMA.

W bazie Repozytorium podczas zapisu zgłoszenia przesłanego przez raportującego zachowywane są informacje o:

- czasie przesłania zgłoszenia (Reporting Timestamp)
- czasie przyjęcia raportu do systemu KDPW_TR (Received DtTm),
- ID przekazującego komunikat, na podstawie którego dokonywany jest wpis – komunikacyjny kod identyfikacyjny raportującego.

Edytowanie raportów za pośrednictwem interfejsu WWW możliwe jest po odnalezieniu w odpowiedniej zakładce raportu podlegającego modyfikacji. W tym celu udostępnione są narzędzia umożliwiające filtrowanie raportów po interesujących użytkownika polach - UTI, data obowiązywania, rodzaj zmiany, itp. Szczegółowe zasady działania interfejsu graficznego opisane zostały w dokumencie „Instrukcja obsługi graficznego interfejsu użytkownika”.

Raportowanie zmian w AT= M, AT=R i AT=V

1) Obsługiwane są następujące przypadki zmiany danych:

- dopisanie nowych wpisów po już istniejących, tzn. modyfikacja (AT=M) lub korekta (AT=R) danych lub aktualizacja wyceny/ zabezpieczenia (AT=V) od daty większej niż ostatni obowiązujący dla danego raportu wpis;
- nadpisanie istniejącej historii, czyli uzupełnienie danych niejako w „środku życia” raportu – zmiana danych w zakresie od daty większej lub równej dacie pierwszego obowiązującego wpisu dla danego raportu i mniejszej lub równej dacie ostatniego obowiązującego wpisu (AT=M, AT=R lub AT=V); przesłanie AT=M, AT=V lub AT=R na daną datę obowiązywania aktualizuje wpis obowiązujący od podanej w komunikacie daty do końca obowiązywania danego wpisu;

Zasady rejestrowania zgłoszeń w poszczególnych rodzajach zmiany

Standardy techniczne obowiązujące od 1 listopada 2017 r. wprowadziły znacznik ‘Level’ (poziom), w którym uczestnik przekazuje informację, czy zgłoszenie dotyczy transakcji (T), czy pozycji (P). Od tego znacznika zależy sposób procesowania zgłoszenia, a w szczególności dostępność rodzajów zmiany, obowiązkowość pól i ich walidacje. Rodzaj zmiany AT=P (składnik pozycji) oraz AT=Z (kompresja) dostępne są tylko dla raportów poziomu T (level T).

AT=N (New)

Komunikat rejestracji (AT=N) wykorzystywany jest do zarejestrowania raportu nowej transakcji/pozycji w Repozytorium. W ramach tego komunikatu podmiot raportujący zobowiązany jest przekazać komplet danych wymaganych do rejestracji raportu. Po przejściu przez kontrole, na podstawie komunikatu, system KDPW_TR rejestruje nowy raport i wysyła potwierdzenie tego faktu do raportującego zgodnie z konfiguracją komunikatów zwrotnych. Wymagalność wypełnienia poszczególnych pól wynika wprost z zasad walidacji opublikowanych przez ESMA.

W wyniku przesłania AT= N powstaje raport aktywny, widoczny w 'Active reports'.

Wpis powstały w rodzaju zmiany N nie może być nadpisywany rodzajem zmiany N. Skorygowanie błędnych informacji przesłanych w AT=N umożliwia rodzaj zmiany AT=R (korekta), a w przypadku stwierdzenia, że transakcja/pozycja o podanym UTI nie miała miejsca, można do niej wysłać AT=E, co skutkuje usunięciem wszystkich wpisów powstałych dla danego raportu i **uniemożliwia** ponowne przesłanie zgłoszenia z tym samym UTI (kluczem raportu).

W interfejsie graficznym zgłoszenie raportów odbywa się za pośrednictwem dostępnego formularza odpowiadającego strukturze komunikatu zgłoszenia do KDPW_TR, bądź za pomocą funkcji 'Import XML', która pozwala zaimportować do KDPW_TR plik XML z rodzajem zmiany N. W zakładce 'Reporting service' udostępniona została funkcja zgłoszenia raportu, gdzie po wyborze opcji Action Type New pojawia się formularz służący do wprowadzenia szczegółów kontraktu. Po wprowadzeniu wartości, użytkownik zatwierdza zgłoszenie. W przypadku pojawienia się błędu merytorycznego w komunikacie, w zakładce 'TR Communication' udostępniany jest komunikat zwrotny trar.sts.003.xx o statusie ERRO, natomiast brak błędów potwierdza komunikat o statusie PACK. W przypadku pozytywnego przetworzenia, raport zostaje zarejestrowany w bazie KDPW_TR.

AT=P (Position component)

Komunikat rejestracji składowej pozycji (AT=P) wykorzystywany jest tylko i wyłącznie do zarejestrowania raportu nowej transakcji, która w dniu jej zawarcia przestaje obowiązywać na skutek zawarcia transakcji przeciwstawnej i zbudowania pozycji, w stosunku do której w dalszym cyklu raportowania przekazywane są raporty aktualizacji wyceny/ zabezpieczeń itp.

W ramach komunikatu AT=P podmiot raportujący zobowiązany jest przekazać komplet danych analogicznie jak dla raportu AT=N, uwzględniając konieczność wypełnienia daty terminacji.

Zasadniczą różnicą w stosunku do raportu AT=N jest fakt, że raport AT=P prezentowany jest od momentu jego zarejestrowania w bazie danych jako raport nieaktywny w 'Non-active reports' .

AT=M (Modify)

Komunikat zmiany szczegółów informacji (AT=M) wykorzystywany jest do zarejestrowania zmian warunków zgłoszonego do KDPW_TR kontraktu, z wyłączeniem korekty zgłoszonych wcześniej wartości¹. Ten rodzaj zmiany obejmuje także aktualizację raportu pozycji odzwierciedlającą włączenie nowych transakcji do tej pozycji. Z powyższego wynika, że raport, którego zmiana jest zgłaszana, musi znajdować się już w systemie KDPW_TR (musi być wcześniej zarejestrowany przy pomocy zgłoszenia z rodzajem zmiany N). W ramach komunikatu AT=M, podmiot raportujący zobowiązany jest przekazać

¹ Różnicę pomiędzy modyfikacją a korektą danych definiuje podmiot raportujący.

Modyfikacja rozumiana jest jako zmiana warunków transakcji, podczas kiedy korekta rozumiana jest jako 'poprawka' do błędnie zaraportowanych danych.

klucz raportu pozwalający na identyfikację odpowiedniego, poddanego modyfikacji raportu oraz datę obowiązywania zmian.

Dodatkowo, jeśli chcemy dokonać jakiegokolwiek zmiany w raportach 'starych' czyli zgłoszonych przed walidacją II (przed listopadem 2017) należy dostosować raport do obecnie obowiązujących schematów poprzez wysłanie AT=R a następnie, w dalszej kolejności można dokonać modyfikacji transakcji poprzez wysłanie AT=M.

Warunkiem koniecznym przyjęcia modyfikacji do systemu jest istnienie aktywnego wpisu w historii raportowania, na datę obowiązywania modyfikacji (zmiany), czyli **Eligibility date= Execution Date**.

W przypadkach, gdy uczestnik raportujący zgłosił raporty w imieniu obu stron, modyfikacji może podlegać wybrany raport jednej strony (jeśli podano sekcję Counterparty Specific Data jednokrotnie), bądź dwa raporty – za obie strony kontraktu (jeśli sekcja Counterparty Specific Data występuje dwukrotnie).

W przypadku zmiany pól, dla których zdefiniowane zostały kontrole warunkowe opisane w tabeli walidacji ESMA, niezbędne jest podanie kompletu pól składającego się na tę walidację, co oznacza, że raport AT=M walidowany jest analogicznie do raportu AT=N z wykluczeniem pól: **Compression, Venue of Execution oraz Termination date**, które w AT=M, zgodnie z tabelą walidacyjną EMIR, nie mogą być przekazywane, bo nie występują w AT=N. W AT=M wymagane jest wypełnienie całego kompletu danych, a niewypełnione pola opcjonalne w AT=M zostają wyczyszczone (w bazie prezentowane będą jako pola puste), oczywiście z wyjątkiem pól z kanonu dla Level T: Execution Date, Counterparty Side, Technical Underlying a dla Level P: Execution Date, Technical Underlying.

AT=M (level T)

W AT=M (level T) **nie można** zmienić pól, których zmiana dotyczy całej historii raportu czyli:

- pól z kanonu: Execution Date, Counterparty Side, Technical Underlying. Oznacza to, że jeśli wprowadzimy zmianę w którymkolwiek z ww. pól z kanonu, system przyjmie zgłoszenie AT=M, ale zignoruje zmianę czyli zmiana nie zostanie zapisana w systemie KDPW_TR.
- pól wchodzących w skład klucza raportu: Reporting Counterparty ID, ID of the other counterparty, UTI*;
- pola 'Level';
- pól związanych z wyceną i zabezpieczeniami – modyfikacja tych pól poprzez AT=V.

AT=M (level P)

W AT=M (level P) **nie można** zmienić pól:

- pól wchodzących w skład klucza raportu: Reporting Counterparty ID, ID of the other counterparty, UTI*;
- pola 'Level'
- pól związanych z wyceną i zabezpieczeniami – modyfikacja tych pól poprzez AT=V

Natomiast **można** zmienić wartości pól z kanonu: Execution Date, , Technical Underlying, Venue of Execution dla Eligibility date równej dacie wprowadzania raportu do KDPW_TR (bieżącej dacie)

*Pomyłkę w kluczu raportu, należy zgłosić za pomocą AT=E, co spowoduje usunięcie raportu wraz z całą jego historią. Nowy, poprawny raport powinien być zgłoszony z nowym identyfikatorem UTI uzgodnionym pomiędzy stronami.

AT=R (Correction)

Jeśli zgłoszony wcześniej wpis zawiera błędne informacje, korektę tych wartości należy zgłosić za pomocą zgłoszenia AT=R.

AT=R wykorzystujemy również w przypadku, jeśli chcemy dokonać jakiegokolwiek zmiany w raportach 'starych' czyli zgłoszonych przed walidacją II (przed listopadem 2017), co jednocześnie powoduje dostosowanie takiego raportu do obecnie obowiązujących schem.

W komunikacie AT=R podawane są wszystkie pola, które mają być skorygowane.

W przypadku korekty pól, dla których zdefiniowane zostały kontrole warunkowe opisane w tabeli walidacji ESMA, niezbędne jest podanie kompletu pól składającego się na tę walidację (analogicznie, jak w przypadku rodzaju zmiany M), co oznacza, że raport AT=R walidowany jest analogicznie do raportu AT=N z zastrzeżeniem możliwości wystąpienia pola 'Termination date', które nie występuje w AT=N. W AT=R wymagane jest wypełnienie całego kompletu danych, a niewypełnione pola opcjonalne w AT=R zostają wyczyszczone (w bazie prezentowane będą jako pola puste).

Przesłanie raportu AT=R zawsze skutkuje nadpisaniem już istniejącego wpisu.

W przypadkach, gdy uczestnik raportujący zgłosił raporty w imieniu obu stron, korekcie może podlegać wybrany raport jednej strony (jeśli podano identyfikatory w sekcji 2 jednokrotnie), bądź dwa raporty – za obie strony kontraktu (jeśli sekcja 2 występuje dwukrotnie).

W AT=R (level T i level P) **nie można** dokonać korekty pól:

- pól wchodzących w skład klucza raportu: Reporting Counterparty ID, ID of the other counterparty, UTI*;
- pola 'Level';
- pól związanych z wyceną i zabezpieczeniami – modyfikacja tych pól poprzez AT=V;
- pól wskazanych w tabeli walidacyjnej ESMA jako puste (są one ignorowane w zgłoszeniu AT=R).

*Pomyłkę w kluczu transakcji, należy zgłosić za pomocą AT=E, co spowoduje usunięcie raportu wraz z całą jego historią. Nowy, poprawny raport powinien być zgłoszony z nowym identyfikatorem UTI uzgodnionym pomiędzy stronami.

W AT=R **można dokonać**:

- korekty pól transakcji aktywnych lub nieaktywnych.
- korekty Pola Counterparty Side - na dowolną EligDt w historii pozycji (Level P) – dla level P pole Counterparty Side zostało wyłączone z kanonu pól

AT=R **umożliwia** korekty:

- **dla pojedynczego wpisu (mutacji):**
 - gdy data obowiązywania 'Eligibility date' jest większa od daty zawarcia 'Execution timestamp', czyli, gdy chcemy skorygować pole Maturity date, dla transakcji, dla której już nastąpiło wygaszenie wg błędnej Maturity date obowiązującej w ostatnim

rekordzie, czyli max EligDt. Jeśli zgłoszenie jest nieaktywne, to po zmianie Maturity date w ostatnim rekordzie wraca do aktywnych i zostaje wygaszone przez AT=T w odpowiednim momencie.)

W takim zgłoszeniu pola z kanonu dla Level T: Execution timestamp, Counterparty Side, Compression, TechUndrlyg, Venue of Execution a dla Level P: Execution timestamp, Compression, TechUndrlyg, Venue of Execution są ignorowane.

- **dla całej historii transakcji:**

- w Level T, gdy data obowiązywania 'Eligibility date' = dacie zawarcia 'Execution timestamp', dla pól z kanonu: Execution timestamp, Counterparty Side, Compression, TechUndrlyg, Venue of Execution,
- w Level P, gdy data obowiązywania 'Eligibility date' = dacie zawarcia 'Execution timestamp', dla pól z kanonu: Execution timestamp, Compression, TechUndrlyg, Venue of Execution,

Zmiana pozostałych pól zastosowana będzie tu tylko w jednym wpisie (mutacji), obowiązującym od dnia 'Eligibility date';

- **dla 'wycinka' historii transakcji:**

- będzie obowiązujące od daty 'Eligibility date' do daty o 1 dzień wcześniejszej, od daty obowiązywania kolejnego wpisu (o ile taki istnieje).

Zmiana daty **Maturity date**

Zmiana wartości w polu Maturity date możliwa jest na każdej pojedynczej mutacji.

Aby zmienić Maturity date, gdy raport jest aktywny i ma więcej niż jedną zmianę (mutację) to 'Eligibility date'=Report Date

Wygaszenie transakcji następuje wg Maturity date obowiązującej w ostatnim rekordzie, czyli max 'Eligibility date'. Jeśli zgłoszenie było nieaktywne, to po zmianie Maturity date w ostatnim rekordzie wraca do aktywnych.

Wycofanie terminacji transakcji

Aby wycofać terminację transakcji, która została sterminowana poprzez wysłanie AT=C, należy wysłać AT=R, na ostatni wpis (mutację), gdzie '**Eligibility date**' = '**termination date**', jednocześnie usuwając wprowadzoną wartość w polu 'termination date'. Pozostałe dane dotyczące tej transakcji, powinny być takie same jak były na moment, w którym została ona sterminowana.

Zmiana daty terminacji

Zmiana daty terminacji na późniejszą niż obecnie zgłoszona

Zmiana daty terminacji na późniejszą niż obecnie zgłoszona następuje poprzez zgłoszenie AT=R z podaniem daty terminacji, przy czym 'Eligibility date' jest równa dacie ostatniego obowiązującego wpisu (mutacji).

W takim przypadku Repozytorium zapisze AT=R na datę 'Eligibility date', z wyczyszczoną datą terminacji oraz nowe C lub Z, obowiązujące na nową datę terminacji. KDPW_TR waliduje, czy zgłoszenie było nieaktywne na podaną datę 'Eligibility date' (tzn. czy data terminacji była wypełniona); jeśli nie, to raport zmieniający datę terminacji zostanie odrzucony.

Zmiana daty terminacji na wcześniejszą niż obecnie zgłoszona

Zmiana daty terminacji na wcześniejszą niż obecnie zgłoszona następuje poprzez zgłoszenie AT=R obowiązujące na ostatnio zgłoszoną datę terminacji, bez podania daty terminacji oraz AT=C/Z obowiązujące na nową datę terminacji.

W takim przypadku KDPW_TR aktywuje zgłoszenie obowiązujące w obecnie obowiązującej dacie terminacji, a po zgłoszeniu AT=C/Z powstanie nowy zapis, jednocześnie wszystkie mutacje po nowej dacie terminacji zostaną usunięte (zachowane w bazie KDPW_TR, ale niedostępne dla raportującego).

Zmiana daty Execution timestamp

Przy pomocy komunikatu R (AT=R) możemy zmienić datę Execution timestamp na wcześniejszą niż zaraportowana pierwotnie.

Natomiast zmiana daty Execution timestamp na późniejszą, nie jest możliwa. Pozostaje jedynie przekazanie komunikatu typu E i ponowne zaraportowanie transakcji z prawidłowymi danymi.

AT=C (Early Termination)

Rodzajem zmiany C raportowane są przypadki zakończenia kontraktu przed jego datą zapadalności. Tym rodzajem zmiany raportowane są tylko i wyłącznie całkowite terminacje kontraktu, natomiast każda częściowa terminacja powinna zostać zgłoszona rodzajem zmiany 'M'.

Każdą terminację (AT=C) uznajemy za całkowitą. Taki wpis otrzymuje zawsze status N (nieaktywny). Zgodnie z tabelą walidacyjną ESMA w zgłoszeniu AT=C wymagany jest tylko klucz transakcji oraz Data terminacji. Zgłoszenia zawierające inne wartości są odrzucane.

Podanie w sekcjach Counterparty Specific Data i Transaction Data klucza raportu (Reporting Counterparty Id + Other Counterparty Id + UTI) oraz daty terminacji jest obowiązkowe, przy czym przeprowadzane są następujące kontrole:

- jeśli w zgłoszonym już raporcie data Maturity Date jest podana, to Termination Date podana w zgłoszeniu AT=C musi być mniejsza niż lub równa podanej Maturity Date; w przeciwnym przypadku komunikat jest odrzucony;
- jeśli w zgłoszeniu wartość wskazana w polu Termination Date jest późniejsza niż data raportowania, zgłoszenie zostaje odrzucone przez system KDPW_TR.

Raport o terminacji na datę obowiązywania większą lub równą dacie realizacji transakcji skutkuje dopisaniem obowiązującego na tę datę wpisu AT=C.

Raport o terminacji na datę obowiązywania mniejszą niż data realizacji transakcji skutkuje odrzuceniem komunikatu.

W wyniku przesłania AT= C powstaje wpis nieaktywny.

AT=Z (Compression)

Rodzajem zmiany Z raportowane są przypadki kompresji kontraktu przed jego datą zapadalności. Raport AT=Z można przekazać tylko i wyłącznie do raportu o transakcji, kompresja raportu o pozycji nie jest możliwa.

Raport skompresowany otrzymuje status N (nieaktywny) w bazie danych. Zgodnie z tabelą walidacyjną ESMA w zgłoszeniu AT=Z wymagany jest tylko klucz transakcji oraz data terminacji rozumiana jako data kompresji. Zgłoszenia zawierające inne wartości są odrzucane.

Podanie w sekcjach Counterparty Specific Data i Transaction Data klucza raportu (Reporting Counterparty Id + Other Counterparty Id + UTI) oraz daty terminacji jest obowiązkowe, przy czym przeprowadzane są następujące kontrole:

- jeśli w zgłoszonym już raporcie data Maturity Date jest podana, to Termination Date podana w zgłoszeniu AT=Z musi być mniejsza niż lub równa podanej Maturity Date; w przeciwnym przypadku komunikat jest odrzucany;
- jeśli w zgłoszeniu wartość wskazana w polu Termination Date jest późniejsza niż data raportowania, zgłoszenie zostaje odrzucone przez system KDPW_TR.

Raport o kompresji na datę obowiązywania większą lub równą dacie realizacji transakcji skutkuje dopisaniem obowiązującego na tę datę wpisu AT=Z.

Raport o kompresji na datę obowiązywania mniejszą niż data realizacji transakcji skutkuje odrzuceniem komunikatu.

W wyniku przesłania AT= Z powstaje wpis nieaktywny.

AT=V (Valuation and collateral update)

Komunikat trar.ins.001.xx z rodzajem AT=V służy do obsługi raportów aktualizacji wyceny oraz/ lub zabezpieczeń transakcji/ pozycji.

Aktualizację wyceny dla danego produktu można przekazać zbiorczo za pomocą dedykowanego komunikatu trar.ins.002.xx.

Aktualizację zabezpieczeń dla danego portfela można przekazać zbiorczo za pomocą dedykowanego komunikatu trar.ins.001.xx, w którym pole UTI pozostaje puste.

Aktualizacja wyceny

Zgłoszenia wyceny transakcji/ pozycji można dokonać komunikatem podstawowym trar.ins.001.xx, dla rodzaju zmiany New (N) wypełniając sekcję Valuation, z zastrzeżeniem, iż data zawarcia musi być, co do daty, równa dacie wyceny. Jeśli data zawarcia jest różna od daty wyceny to komunikat zostaje odrzucony.

Zgłoszenia lub aktualizacji wyceny transakcji można dokonać modyfikując:

- pojedynczą transakcję komunikatem trar.ins.001.xx – (AT=V), wypełniając sekcję Valuation;
- potencjalnie wiele transakcji wysyłając wycenę produktu komunikatem zbiorczym trar.ins.002.xx.

W trakcie zgłaszania wyceny w dedykowanym polu *Valuation timestamp* odpisywana jest data i godzina wyceny. Jest to szczególnie istotne w przypadku wielokrotnego raportowania zmian wyceny na tę samą datę. Wówczas obowiązujące na dany dzień jest zgłoszenie z najpóźniejszą godziną zaraportowaną w polu *Valuation timestamp* na dany dzień. Wszystkie zgłoszenia z wcześniejszą godziną *Valuation timestamp* na dany dzień są nieobowiązujące, ale zachowywane w bazie KDPW_TR. W praktyce oznacza to, iż dla wyznaczenia obowiązującego wyceny nie jest decydujący moment zaraportowania, jak to mam miejsce w przypadku innych rodzajów zmiany, lecz właśnie data i godzina wskazana w polu *Valuation timestamp*.

Zgłoszenie wyceny komunikatem podstawowym (trar.ins.001.xx AT=V), której *Valuation timestamp* jest równy *Valuation timestamp* wcześniej zgłoszonej przez uczestnika za pomocą trar.ins.001.xx AT=V wycenie powoduje zapisanie nowej wyceny jako obowiązującej, a wcześniej zgłoszona wycena przestaje obowiązywać.

Zgłoszenie wyceny zbiorczej, której *Valuation timestamp* jest równy co do dnia i godziny *Valuation timestamp* wcześniej zgłoszonej przez uczestnika wycenie zbiorczej powoduje zapisanie nowej wyceny jako obowiązującej, a wcześniej zgłoszona wycena przestaje obowiązywać.

Wycena zbiorcza (na produkt) zgłoszona na dany dzień jest przyporządkowana do wszystkich transakcji aktywnych na danym produkcie w danym dniu na moment zgłoszenia wyceny zbiorczej. Oznacza to, że wycena taka nie obejmuje również transakcji, które zostały zgłoszone po przyjęciu i przetworzeniu komunikatu trar.ins.002.xx, tj. z późniejszym *reporting timestamp*'em, o ile nie została do nich przypisana wycena z późniejszą godziną obowiązywania.

Wycena zgłoszona komunikatem zbiorczym (na produkt) jest przyjmowana, niezależnie od tego czy istnieją już jakiegokolwiek transakcje na produkt, którego wycena jest zgłaszana tym komunikatem zbiorczym.

Anulowanie transakcji, tzn. przesłanie AT=E do AT=N powoduje anulowanie całej historii transakcji, włącznie z wszystkimi AT=V przesłanymi do danej transakcji. AT=V zbiorcze nie zostają usunięte z bazy danych KDPW_TR, gdyż mogą dotyczyć także innych transakcji.

W interfejsie graficznym, wycena kontraktu jest widoczna w opcji View, w zakładkach: 'Active reports' i 'Non-active reports'. Prezentowane są wartości 4 pól:

- Value of contract,
- Currency of the value,
- Valuation timestamp,
- Valuation type.

W wyniku zapytania trar.rqs.001.xx uczestnik otrzymuje historię transakcji (w tym wyceny).

Aktualizacja zabezpieczeń

Uczestnik raportujący może zgłosić zabezpieczenie zawartej transakcji z wykorzystaniem komunikatu podstawowego trar.ins.001.xx (AT=N lub AT=V), w którym podaje kod UTI w sekcji Collateral lub zabezpieczenie całego swojego portfela (analitycznego bądź syntetycznego) za pomocą komunikatu trar.ins.001.xx (AT=V), w którym nie podaje UTI a wskazuje kod portfela.

Raportując zabezpieczenie na portfel uczestnik w pierwszej kolejności musi wskazać kod portfela używając do tego celu AT=N lub AT=V. Nie jest możliwe zaraportowanie kodu portfela przy użyciu AT=N z równoległym wskazaniem wartości w pozostałych polach związanych z raportowaniem zabezpieczeń.

Zatem, sekcję collateral można podać w AT=N i AT=V per pojedyncza transakcja - wskazując UTI.

W AT=N można zaraportować również kod portfela, jeśli planujemy raportowanie zbiorcze zabezpieczeń.

W AT=V nie ma żadnych blokad dla kodu portfela:

- jeśli przekazane wartości zabezpieczeń będą z wypełnionym kodem portfela, ale **bez wskazania UTI** – będzie to zabezpieczeniem zbiorczym, na portfel
- jeśli przekazane wartości zabezpieczeń będą z wypełnionym kodem portfela, ale **ze wskazaniem UTI** – kod portfela zostanie dopisany do wskazanej transakcji/pozycji, wartości zabezpieczeń zostaną zaktualizowane, ale tylko na podaną w AT=V EligDt i tylko dla tej transakcji/pozycji.

UWAGA: raportując zabezpieczenia na kod portfela należy pamiętać, że osobno wysyłamy komunikat do transakcji (Level T) i osobno dla pozycji (Level P).

~~Przyporządkowanie zabezpieczenia zbiorczego (na portfel) odbywa się na zasadzie łączenia według pola Portfolio, tzn. pola Portfolio przekazanego wcześniej w komunikacie AT=N trar.ins.001.xx z podanym UTI z polem Portfolio z komunikatu trar.ins.001.xx, gdzie UTI jest puste – oznacza to, że zabezpieczenie zbiorcze przyporządkowywane jest do tych wszystkich raportów, które w polu Portfolio zabezpieczenia mają kod portfela zgodny z polem Portfolio przekazywanym w zabezpieczeniu zbiorczym.~~

W przypadku wielokrotnego raportowania zmian zabezpieczenia na tę samą datę, obowiązujące na dany dzień jest zgłoszenie z najpóźniejszą godziną raportowania. Wszystkie wcześniejsze zgłoszenia na dany dzień są nieobowiązujące, ale zachowywane w bazie KDPW_TR.

Zabezpieczenie zbiorcze (na portfel) zgłoszone na dany dzień przyporządkowywane jest do wszystkich transakcji aktywnych w danym dniu w momencie przyjęcia zgłoszenia zbiorczego, dla których w polu Portfolio wskazano kod identyczny z tym zgłoszonym w komunikacie zbiorczym. Oznacza to, że zgłoszenie takie nie obejmuje również transakcji, które zostały zgłoszone po przyjęciu i przetworzeniu komunikatu zbiorczego, tj. z późniejszym Reporting timestamp.

Zabezpieczenie zgłaszane komunikatem zbiorczym (na portfel) jest przyjmowane i zapisywane w bazie KDPW_TR, niezależnie od tego czy istnieją już jakiegokolwiek transakcje z oznaczeniem portfela, którego zabezpieczenie jest zgłaszane tym komunikatem zbiorczym.

W interfejsie WWW wycena kontraktu jest widoczna w opcji View, w zakładkach: 'Active reports' i 'Non-active reports'. Prezentowane są wartości pól:

- Collateralisation,
- Collateral portfolio,
- Collateral portfolio code,

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

W wyniku zapytania trar.rqs.001.xx uczestnik otrzymuje historię transakcji (w tym zabezpieczenia).

AT=E (Error)

Komunikat z rodzajem zmiany AT=E wykorzystywany jest do usunięcia zarejestrowanego w bazie KDPW_TR raportu. Wymagane jest podanie w sekcjach Counterparty Specific Data i Common Trade Data klucza transakcji (Reporting Counterparty Id + Id of the Other Counterparty + UTI).

AT=E usuwa całą historię raportu i uniemożliwia ponowne zaraportowanie raportu o takim samym kluczu. Restrykcja ta dotyczy obu stron kontraktu.

Anulowany raport jest widoczny dla uczestników Repozytorium w zakładce 'Deleted reports'.

Jeśli raporty zostały złożone do KDPW_TR za obie strony kontraktu, to anulowanie raportu przez jedną ze stron powoduje blokadę zgłaszania do tego raportu jakichkolwiek zmian poza AT=E dla drugiej strony. Informacja o zablokowanych raportach (tzn. anulowanych przez drugą stronę) przesyłana jest do raportującego, za pośrednictwem komunikatu notyfikacyjnego trar.ntf.001.xx, z polem Reason code wypełnionym wartością 'Trade annulled (AT=E) by the other counterparty'.

Obsługa komunikatów przepytujących (trar.rqs)

Komunikat przepytujący trar.rqs.001.xx pozwala na pobranie zdefiniowanych za pomocą filtrów danych w formacie xml.

Komunikat umożliwia filtrowanie danych o wybranej transakcji/ pozycji poprzez:

- wybór raportów o wybranych parametrach (np. dla konkretnego kontrahenta lub dla wybranego rynku) obowiązujących w danym dniu lub okresie czasu,
- wybór historii pojedynczego raportu o wybranym UTI (TradId) obowiązującego w danym dniu lub okresie czasu.

Umożliwienie filtrowania danych o liście transakcji/ pozycji odbywa się poprzez zdefiniowanie daty, na jaką dane mają obowiązywać bądź poprzez zdefiniowanie okresu dla raportów obowiązujących

we wskazanym przedziale czasu. Dodatkowe pola służą do filtrowania danych wg kontrahenta, rynku, statusu raportu.

W przypadku zapytania o pojedynczy raport możliwe jest filtrowanie danych o transakcji / pozycji na daną datę bądź za dany okres czasu.

Obsługa procesu parowania i porównywania danych

Proces rekonyliacji danych, na który składa się parowanie danych w oparciu o klucz raportu (złożenie identyfikatorów transakcji/ pozycji, kontrahenta oraz drugiego kontrahenta) oraz porównywanie poszczególnych danych składających się na raport, został opisany w odrębnym dokumencie pt. „*Opis procesu rekonyliacji danych w raportach zgłaszanych do KDPW_TR*”.

Wersjonowanie danych

Wraz z wdrożeniem aktualizacji standardów technicznych z początkiem listopada 2017 r. dane przechowywane w bazie KDPW_TR zaczęły być prezentowane tak na potrzeby Uczestników, jak i Nadzorców, w oparciu o wersję standardów, zgodnie z którą raporty były przekazywane.

Raporty przekazane przed aktualizacją standardów technicznych, w przypadku których podmiot raportujący nie aktualizował zakresu danych, prezentowane są za pośrednictwem komunikatu trar.sts.001 w wersji 02 (tj. trar.sts.001.02) w zakresie odpowiedzi na aktualizację wyceny/zabezpieczeń, terminacje, kompresje, wygaszanie raportu w dacie zapadalności i podobnie w przypadku komunikatu notyfikacji, trar.ntf.001 w wersji 01 tj. trar.ntf.001.01 oraz komunikatu przepytującego trar.rqs.001 w wersji 02 tj. trar.rqs.001.02; zaś raporty zgodne z zakresem informacyjnym zaktualizowanych standardów technicznych, prezentowane są za pośrednictwem komunikatu trar.sts.001 w wersji 03 (tj. trar.sts.001.03) i komunikatu trar.ntf.001 w wersji 02 tj. trar.ntf.001.02 oraz komunikatu trar.rqs.001. w wersji 03 tj. trar.rqs.001.03