

**OPIS PROCESU REKONCYLIACJI DANYCH W RAPORTACH ZGŁASZANYCH DO REPOZYTORIUM
TRANSAKCJI KDPW_TR (EMIR)****SPIS TREŚCI**

I	SŁOWNIK POJĘĆ I DEFINICJE	2
II	RAPORTY PODLEGAJĄCE PROCESOWI REKONCYLIACJI	4
III	OPIS DZIAŁANIA PROCESU REKONCYLIACJI.	5
IV	PROCESY W REKONCYLIACJI.....	7
IV.1.	PAROWANIE /PAIRING/.....	7
IV.2.	REPOZYTORIUM TRANSAKCJI KDPW_TR (EMIR). PORÓWNYWANIE /COMPARING/.....	8
V	ZAŁĄCZNIKI	12
V.1.	ZAŁĄCZNIK 1 – ZASADY PORÓWNYWANIA PÓL EMIR RTS	12
V.2.	ZAŁĄCZNIK 2 – LISTA KODÓW WYNIKÓW PROCESU REKONCYLIACJI.....	25

Wstęp

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

Każdy kontrakt pochodny ma dwie strony: kontrahenta kupującego i kontrahenta sprzedającego. Jeżeli obie strony kontaktu są zobowiązane złożyć raport dotyczący zawartej transakcji pochodnej to oba raporty mogą znaleźć się w tym samym repozytorium lub mogą się znaleźć w różnych repozytoriach. Od momentu (dzień T) realizacji transakcji (Execution timestamp) lub daty obowiązywania zmiany (Eligible Date), kontrahenci są zobowiązani do ich zaraportowania w terminie do końca następnego dnia roboczego (T+1). W związku z tym, proces rekonceiliacji rozpoczyna się najwcześniej kolejnego dnia roboczego, czyli w dniu T+2, każdego dnia od poniedziałku do piątku, nie wyłączając dni świątecznych. W przypadku raportów opóźnionych tzn. takich dla których przekroczono termin raportowania T+1, to biorą one udział w procesie rekonceiliacji w następnym dniu roboczym po dniu ich zgłoszenia do TR.

Weryfikowanie zgodności szczegółów transakcji i pozycji 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. Wynikiem procesu jest oznaczenie statusu parowania i porównywania raportów. Informacje te przesyłane są do uczestników raportujących w formie komunikatu xml po pierwszej rekonceiliacji oraz po każdorazowej zmianie jej wyników.

I Słownik pojęć i definicje

1. Tabela skrótów używanych w dokumencie:

AT	Action Type – pole z tabeli walidacyjnej ESMA, które może przyjmować wartości: N, M, R, V, C, E, P, Z
EEA	Europejski Obszar Gospodarczy (European Economic Area)
EMIR RTS	EMIR – Regulacyjne Standardy techniczne (EMIR-Technical Standards)
ESMA	Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (European Securities and Markets Authority)
Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR)	Prowadzone przez KDPW Repozytorium transakcji dla instrumentów pochodnych
LEI kod	Kod LEI (Legal Entity Identifier) to unikalny, 20 znakowy identyfikator podmiotu prawnego nadawany przez lokalne agencje kodujące (LOU) akredytowane przez Global Legal Entity Identifier Foundation (GLEIF).
TR	Repozytorium Transakcji (Trade Repository)

UTC	Skoordynowany czas uniwersalny (Universal Time Coordinated)
UTI	Unikalny identyfikator transakcji/pozycji (Unique Trade Identifier - Trade ID)
UPI	Unikalny identyfikator produktu (Unique Product Identifier)
RSE	Kod identyfikacyjny podmiotu przedstawiającego zgłoszenie (Report Submitting Entity)
Dzień T	Data wykonania transakcji (Execution timestamp) dla AT=N i AT=P i Level=T lub data początku obowiązywania (Eligible Date) dla pozostałych raportów
Execution timestamp	Data i czas kiedy kontrakt został zrealizowany. Pole 2.25 tabeli walidacyjnej ESMA (http://www.kdpw.pl/layouts/download.aspx?sourceUrl=/pl/Repozytorium%20transakcji%20wersa%20EMIR/Documents/EMIR_validation_table_ESMA_122019.xlsx)

2. Definicje:

Dni rekoncyliacyjne	Dni rekoncyliacyjne to wszystkie dni robocze wg TARGET CALENDAR
Dni robocze	wszystkie dni robocze wg TARGET CALENDAR
Paired (sparowany)	Identyfikator UTI jest sparowany, gdy TR jest repozytorium dla jednej strony transakcji/pozycji podlegającej zgłoszeniu i połączył drugą stronę z innego TR w oparciu o Listę wymagań (RL) lub repozytorium ma obie strony transakcji/pozycji podlegającej zgłoszeniu. Termin sparowane może być użyty 1) obejmujący wszystkie UTI spełniającymi powyższą definicję, gdy jest używany w kontekście sparowanych i niesparowanych lub 2) obejmujący UTI spełniającymi powyższą definicję, które nie są dopasowane do pól kategorii 1 i 2 w kontekście niesparowanych, sparowane, dopasowane lub uzgodnione.
Unpaired (NPAR) (niesparowany)	Identyfikator UTI nie jest sparowany, gdy TR jest repozytorium jednej strony transakcji/pozycji podlegającej zgłoszeniu i nie powiązał go z drugą stroną z innego TR.
Unmatched 1 (ERR1)– (niedopasowany 1)	Te UTI, dla których TR sparował je z innym TR, zakończono porównanie i co najmniej jedno pole kategorii 1 jest niezgodne.
Unmatched 2 (ERR2)– (niedopasowany 2)	Te UTI, dla których TR sparował je z innym TR, zakończono porównanie i co najmniej w jednym polu mamy różnicę kategorii 2 oraz w żadnym polu nie występuje różnica kategorii 1.
Matched (MACH) (zgodny)	Te UTI, dla których TR sparował je z innym TR, zakończono porównanie i wszystkie pola kategorii 1 i kategorii 2 są zgodne.
OTC/ETD	Oznaczenie typu rynku, na którym została zawarta transakcja/pozycja. Definicja typu rynku OTC/ETD oparta jest o tablicę Venue of execution.
TARGET CALENDAR	Kalendarz dni roboczych publikowany przez Europejski Bank Centralny (ECB)

II Raporty podlegające procesowi rekonyliacji

Proces rekonyliacji obejmuje ostatni stan każdej transakcji lub pozycji w danym dniu (tzw. trade state), co oznacza, iż do procesu włączany jest aktualnie obowiązujący raport na koniec dnia rekonyliacyjnego pod warunkiem, że nie nastąpiło co najmniej jedno z niżej wymienionych wyłączeń z procesu:

Typ identyfikatora strony kontraktu.

Jeżeli identyfikator jednej ze stron transakcji/pozycji nie jest kodem LEI, to taki raport jest wyłączony z procesu. W przypadku, gdy obie strony transakcji lub pozycji są identyfikowane za pomocą kodu LEI, system sprawdza kod LEI kontrahenta (Reporting Counterparty ID) oraz kod LEI drugiej strony (Id of the Other Counterparty), czy znajdują się w bazie GLEIF. Jeżeli kod nie został odnaleziony w bazie GLEIF, raport o danej transakcji/pozycji pochodnej nie wchodzi do procesu.

Kraj drugiego kontrahenta

Z procesu eliminowane są raporty jednostronnie zgłaszane do Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR), z treści których wynika, że druga strona transakcji lub pozycji nie ma obowiązku raportowania, co ma miejsce w przypadku kontrahentów spoza obszaru EEA – na podstawie kodu kraju drugiego kontrahenta (pola Country of the Other Counterparty). System Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) posiada aktualną tabelę kodów krajów należących do EEA. Jeżeli kod kraju drugiej strony transakcji lub pozycji nie znajduje się na liście krajów EEA, raport nie wchodzi do procesu rekonyliacji.

Rodzaj identyfikatora transakcji/pozycji – Trade ID

Trade ID jest walidowany zgodnie z obowiązującymi zasadami określonymi w obowiązującej tabeli walidacyjnej EMIR.

W przypadku niezgodności z obowiązującymi walidacjami pola Trade ID raport nie wchodzi do procesu.

Data otrzymania pierwszego raportu.

Raporty AT=N otrzymane przed 30.10.2017r., dla których dodatkowo został spełniony warunek:

pole Compression = 'Y' nie wchodzi do procesu.

Poziom transakcji lub pozycji.

Z procesu eliminowane są te przypadki pozycji (tj. raportów z wypełnionym w raporcie polu Level='P'), które na dzień 6 grudnia 2019 roku były nieaktywne, chyba, że:

po 6 grudnia 2019 roku do Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) wpłynęła do takiej pozycji raport niebędący wyceną (AT=V) lub anulowaniem (AT=E, w tym wypadku pod warunkiem wcześniejszego otrzymania do niego raportu innego niż AT=V po 6 grudnia 2019 roku)

lub do Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) zostanie przekazany przez inne TR plik RL zawierający klucz takiej pozycji.

III Opis działania procesu rekoncyliacji.

Parowanie

Proces rekoncyliacji rozpoczyna się od ustalenia, które z raportów o zawartych kontraktach pochodnych powinny wejść do procesu. Następnie wykonywane jest Parowanie, które polega na powiązaniu ze sobą dwóch raportów o tej samej transakcji lub pozycji na podstawie ich kluczy, czyli kombinacji UTI oraz kodów LEI kontrahentów. Aby raporty zostały sparowane, klucze muszą być odpowiadające sobie w jednoznaczny sposób. Parowanie jest podzielone na dwa etapy:

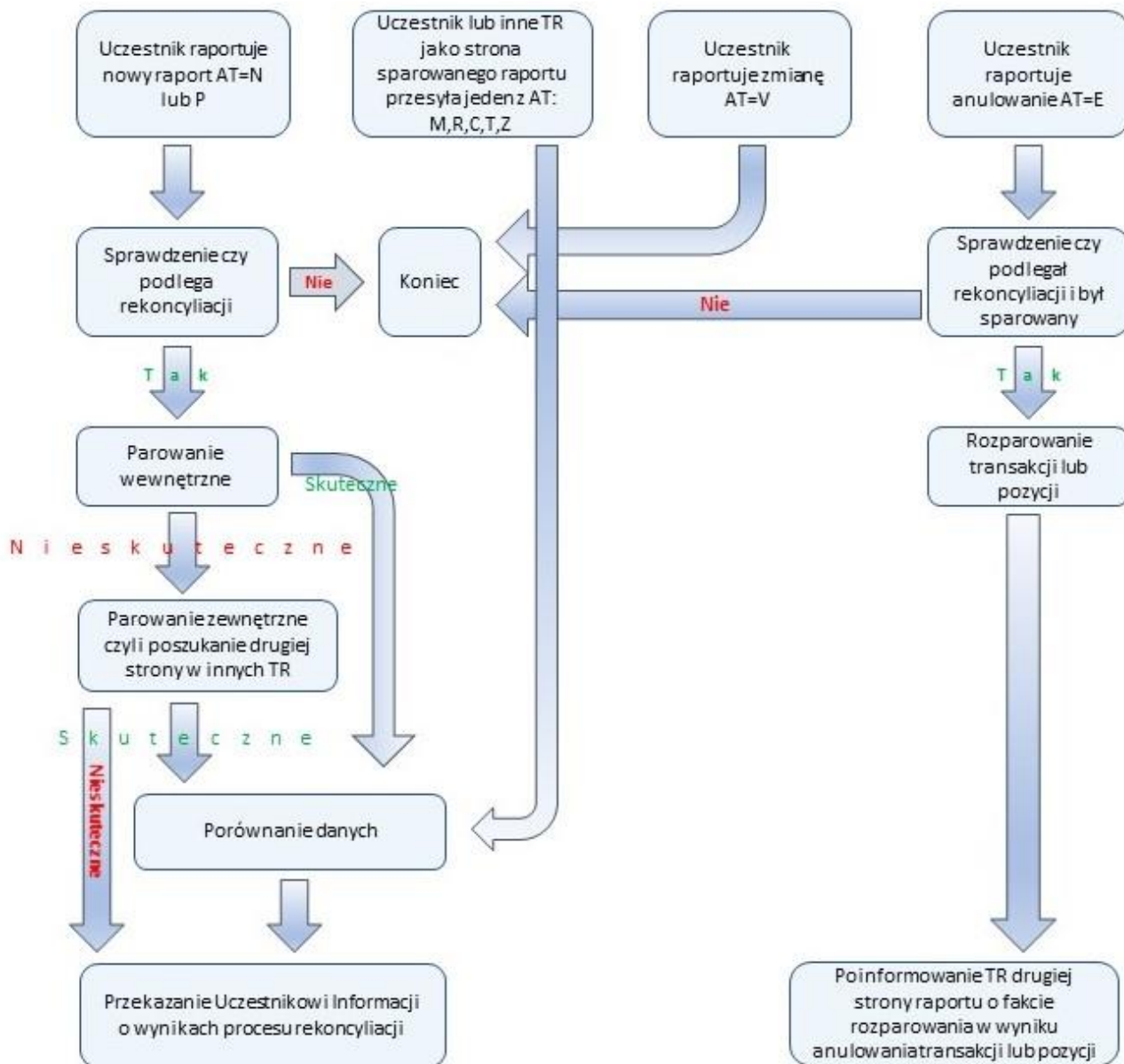
- wewnętrzne,
- zewnętrzne - z innymi TR.

Fakt sparowania lub niesparowania jest odnotowywany przez TR, a informacja o niesparowaniu jest przekazywana uczestnikowi raportującemu (RSE). W przypadku, gdy strony przesłały raporty do różnych TR, to wymieniają się one kluczami raportów w celu znalezienia drugiej strony, co umożliwi wymianę danych i ich porównanie.

Porównywanie

Porównanie sparowanych raportów to ich zestawienie pod kątem zbieżności w zakresie określonych w załączniku nr 1 (Zasady porównywania pól EMIR RTS), w ramach przyjętych tolerancji. Wynik porównania jest przekazywany RSE w postaci dedykowanego rekoncyliacji komunikatu xml (trar.rcn.xx.xxx).

Schemat procesu rekonyliacji – perspektywa Uczestnika raportującego (RSE) do Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR):



IV Procesy w rekoncyliacji

IV.1. Parowanie /Pairing/

Każdego dnia system sprawdza, które z nowych transakcji/pozycji (AT=N lub AT=P) zostały zaraportowane do Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR). Po weryfikacji czy raport kwalifikuje się do procesu przystępujemy do parowania. Zgodnie z opisem zawartym we [wstępie](#) jeśli raport został zgłoszony do KDPW RT w dniu T wtedy jest on włączany do procesu w dniu T+2 (patrz przykład 1), natomiast raporty zgłoszone następnego dnia po dniu T (T+1) lub później biorą udział w procesie następnego dnia po zaraportowaniu (patrz przykład 2 i 3).

Przykład 1:

Transakcja wykonana (**Execution timestamp=dzień T**) 1.07.2020 (środa) i zaraportowana za jedną jej stronę w tym samym dniu bierze udział w procesie parowania w T+2 czyli 3.07.2020 (piątek).

Przykład 2:

Druga strona ww. transakcji raportuje ją 2.07.2020 (czwartek) czyli w T+1, wtedy raport bierze udział w procesie parowania również w T+2 czyli 3.07.2020 (piątek).

Przykład 3:

Druga strona ww. transakcji raportuje ją z opóźnieniem czyli 3.07.2020 (piątek) czyli w T+2, wtedy raport bierze udział w procesie parowania w następnym dniu roboczym (wg. **TARGET CALENDAR**) czyli 6.07.2020 (poniedziałek).

Parowanie raportów jednostronnie zgłaszanych do repozytorium odbywać się będzie na podstawie trójpolowego klucza: UTI oraz kodów LEI obu kontrahentów (Reporting Counterparty ID oraz ID of the Other Counterparty). Pełna zgodność wartości tych pól w przekazanych raportach pozwala na ich sparowanie.

Proces rozpoczyna się od parowania wewnętrznego a następnie raporty, które nie zostały sparowane biorą udział w parowaniu zewnętrznym.

Wynik parowania danych transakcji/pozycji zapisywany jest w bazie danych Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR)

1. Zasady wewnętrznego parowania raportów jednostronnie zgłaszanych do Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR):

Aby raporty dwu stron transakcji/pozycji były uznane za sparowane wewnętrznie powinny być spełnione nw. warunki:

- a) wartości pola UTI w raportach przekazanych w imieniu każdej ze stron transakcji/pozycji muszą być zgodne.
- b) wartości w zakresie LEI kontrahentów muszą zestawiać się krzyżowo, tj.:
 - wartość **Reporting Counterparty ID** z raportu kontrahenta 1 musi być zgodna z wartością **ID of the Other Counterparty** z raportu kontrahenta 2 oraz jednocześnie
 - wartość **ID of the Other Counterparty** z raportu kontrahenta 1 musi być zgodna z wartością **Reporting Counterparty ID** z raportu kontrahenta 2.

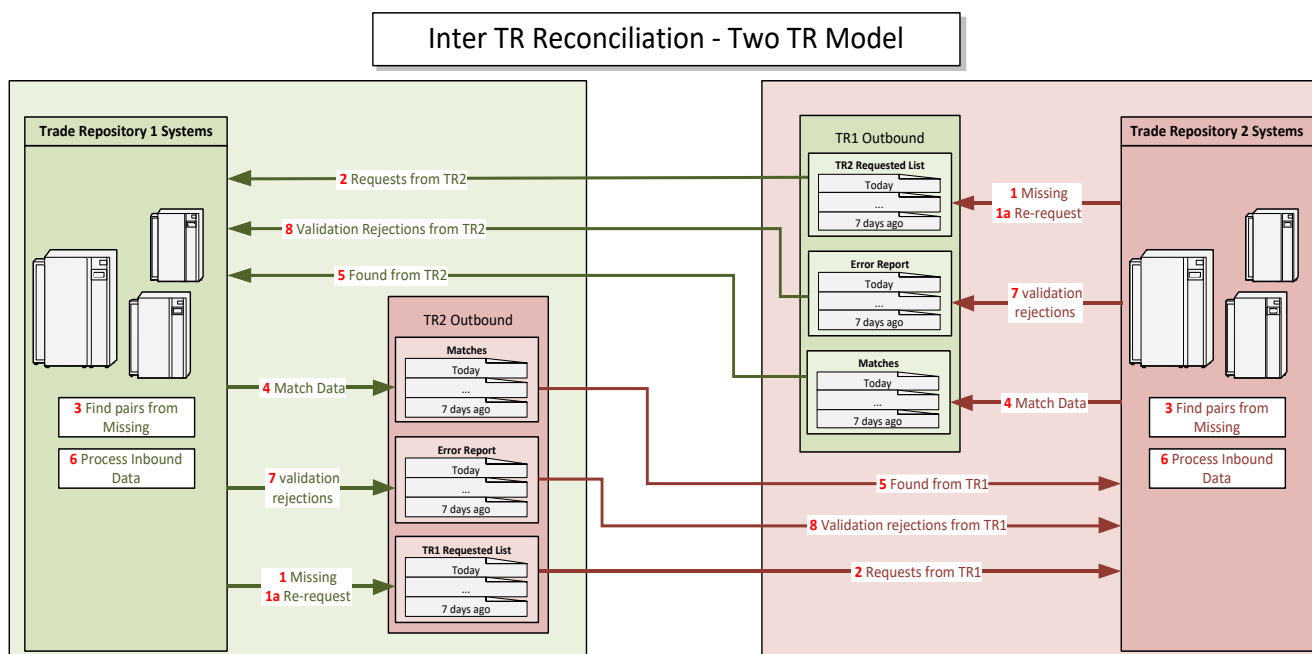
Jeśli raporty nie zostały sparowane wewnętrznie przechodzą do parowania zewnętrznego.

2. Zasady zewnętrznego parowania raportów jednostronnie zgłaszanych do KDPW:

Jeśli w trakcie procesu wewnętrznego parowania raportów nie odnaleziono drugiej strony, zakłada się, że raport drugiej strony transakcji/pozycji został lub zostanie zgłoszony do innego TR. W takim przypadku zachodzi konieczność zewnętrznego parowania poprzez wymianę danych pomiędzy

repozytoriami. W poszukiwaniu drugiej strony transakcji/pozycji repozytoria wymieniają się między sobą jedynie trójpolowym kluczem transakcji/pozycji. Po odnalezieniu drugiej strony następuje wymiana danych określonych w [załączniku 1](#) z właściwym TR.

Schemat procesu rekonyliacji pomiędzy dwoma Repozytoriami transakcji



3. Raporty włączane są do procesu parowania aż do momentu sparowania, ale maksymalnie do 7 kolejnych dni roboczych włącznie.

4. Nieskuteczne parowanie raportów

Nieskuteczne parowanie raportów ma miejsce, kiedy nie znaleziono pary dla danego raportu. W tej sytuacji do RSE zostaje wysłany komunikat informujący o nieskutecznym parowaniu zgłoszonego raportu (szczegóły w sekcji Informowanie o wynikach rekonyliacji raportów).

IV.2. Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR). Porównywanie /Comparing/

Porównaniu są poddawane te raporty o sparowanych transakcjach/pozycjach pochodnych, dla których do Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) trafia inny rodzaj zmiany niż AT=V lub AT=E. Repozytoria wymieniają się danymi do porównania za każdym razem, gdy otrzymają nowy raport o transakcji lub pozycji.

Jeśli w bazie Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) znajduje się klucz sparowany z innym TR w którym druga strona zaraportuje zmianę, wówczas informację o tym fakcie powinniśmy otrzymać z innego TR. Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) dokonuje wtedy porównania najnowszych danych z obowiązującymi aktualnie danymi w Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR).

Zasady porównywania raportów są takie same dla raportów sparowanych wewnętrznie jak i zewnętrznie. Raporty niesparowane nie podlegają porównywaniu.

Porównywanie raportów przeprowadzane jest gdy nastąpi jakkolwiek modyfikacja danych (z wyłączeniem sekcji wycena) po jednej lub z obu stron.

Proces porównania polega na zestawieniu wartości i sprawdzeniu, czy występują różnice w odpowiadających sobie polach obu stron sparowanej transakcji/pozycji. Podczas zestawiania stosowane są następujące zasady kontroli tolerancji w procesie porównywania danych raportów (w zależności od użytego formatu danych):

Kontrola tolerancji 1:

- różnica wartości kwotowych dot. porównywanych transakcji/pozycji nie może przekraczać 1%.

Kontrola tolerancji 2:

- wartości kwotowe dot. porównywanych transakcji/pozycji muszą być identyczne na lewo od przecinka wartości ułamkowych.

Kontrola tolerancji 3:

- dla OTC data i czas porównywanych transakcji/pozycji muszą zestawiać się, co do elementu daty transakcji/pozycji,
- dla ETD dodatkowo różnica porównywanych czasów nie może przekraczać 1 godziny.

Definicja typu rynku OTC/ETD oparta jest o tablicę Venue of execution. Zgodnie z *Regulaminem Repozytorium transakcji dla instrumentów pochodnych* przyjmuje się, że rynek OTC oznaczony jest tylko na jeden z wymienionych sposobów: 'XXXX' lub 'XOFF'.

Kontrola tolerancji 4:

- data i czas porównywanych transakcji/pozycji muszą zestawiać się, co do elementu daty transakcji/pozycji.

Dodatkowo pola z tabeli walidacyjnej EMIR zostały podzielone na poniższe kategorie:

Kategoria 1 – Pole zostanie poddane porównaniu. Jeśli pole nie będzie uzgodnione w ramach uzgodnionej tolerancji, kontrahenci zgłaszający muszą uzgodnić wartość pola w pierwszej kolejności.

Kategoria 2 – Pole zostanie poddane porównaniu. Jeśli pole nie będzie uzgodnione w ramach uzgodnionej tolerancji, kontrahenci zgłaszający muszą uzgodnić wartość pola w drugiej kolejności.

Kategoria 3 – Wartość pola nie będzie poddawana procesowi porównywania.

Tabela z zasadami porównywania, stosowania kontroli tolerancji oraz przydziałem pól do odpowiednich kategorii znajduje się w [Załączniku 1: Zasady porównywania pól EMIR RTS](#). Pola istniejące w tabeli walidacyjnej, a nie ujęte w załączniku 1 nie podlegają porównaniu.

Do raportów sparowanych wewnętrznie używamy wyłącznie danych z bazy Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR).

Do raportów sparowanych zewnętrznie używamy danych z bazy Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) przekazanych przez RSE oraz danych z innego TR, z którym został sparowany raport. Lista pól, jakie powinny znaleźć się w pliku z danymi od innego RT znajduje się w [Załączniku 2](#).

2. Skuteczne porównanie raportów:

Wynik porównania danych transakcji/pozycji zapisywany jest w bazie danych Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) i przekazywany do RSE.

Obecnie występujące statusy porównania:

ERR1 (niedopasowany 1) – taki status porównania dostaje transakcja/pozycja, która została sparowana, zostało wykonane jej porównanie i w jego wyniku w co najmniej jednym polu mamy różnicę kategorii 1.

ERR2 (niedopasowany 2) – taki status porównania dostaje transakcja/pozycja, która została sparowana, zostało wykonane jej porównanie i w jego wyniku w co najmniej jednym polu mamy różnicę kategorii 2 oraz w żadnym polu nie występuje różnica kategorii 1.

MACH (zgodny) – taki status porównania dostaje transakcja/pozycja, która została sparowana, zostało wykonane jej porównanie i w jego wyniku wszystkie pola kategorii 1 i 2 są zgodne w ramach obowiązujących tolerancji.

3. Informowanie o wynikach rekonyliacji raportów

Repozytorium transakcji KDPW_TR (EMIR) informuje swoich Uczestników raportujących (RSE) o wynikach procesu rekonyliacji, tj.:

- a) nieskutecznym parowaniu raportów, jednorazowo, ale zawsze po zmianie statusu parowania na niesparowany
- b) wyniku każdego porównania raportów, jednorazowo, w tym:
 - o wszystkich rozbieżnościach Kategorii 1 w porównywanych raportach łącznie z wartością jaka znajduje się w porównywanym polu u drugiej strony transakcji/pozycji,
 - o wszystkich rozbieżnościach Kategorii 2 w porównywanych raportach łącznie z wartością jaka znajduje się w porównywanym polu u drugiej strony transakcji/pozycji,
 - o braku rozbieżności w porównywanych raportach.

KDPW przekazuje informacje o wynikach rekonyliacji w postaci odrębnego komunikatu (trar.rcn.001.XX, gdzie XX to aktualna wersja komunikatu). Lista kodów błędów przesyłanych w komunikatach rcn znajduje się w [Załączniku 2-Lista kodów wyników procesu rekonyliacji](#) w niniejszym dokumencie.

Raport informujący o wynikach rekonyliacji raportów poza ogólną informacją o statusie rekonyliacji (statusy opisane w [punkcie 2](#)) dodatkowo zawiera powtarzalną sekcję [1..n] dotyczącą wszystkich przyczyn oraz opisów przyczyn, dla każdej rozbieżności, która wystąpiła w wyniku porównania raportów. Ponadto, w przypadku wystąpienia rozbieżności podawane są również wartości przekazane w tym polu przez drugą stronę. Przykładowe fragmenty raportów rcn zostały zamieszczone poniżej:

A. W tagach `<CtrPtyVal>` i `<OthrCtrPtyVal>` podane są dwie wartości, których wynik porównania ze sobą powoduje różnicę kategorii 1:

```
<trar.rcn.001.03>
.....
<Sts>
  <StsCd>ERR1</StsCd>
  <Rsn>
    <RsnCd>ECNF</RsnCd>
    <RsnTxt>Inconsistency in field Confirmation timestamp</RsnTxt>
    <CtrPtyVal>2020-06-16T10:00:00</CtrPtyVal>
    <OthrCtrPtyVal>2020-06-18T12:18:43</OthrCtrPtyVal>
  </Rsn>
  <Rsn>
    <RsnCd>ECNM</RsnCd>
    <RsnTxt>Inconsistency in field Confirmation means</RsnTxt>
    <CtrPtyVal>E</CtrPtyVal>
    <OthrCtrPtyVal>Y</OthrCtrPtyVal>
```

```
        </Rsn>
    </Sts>
</trar.rcn.001.03>
```

B. W przypadku raportu niesparowanego <StsCd>NPAR</StsCd>, jego data parowania ma umowną wartość <ParDt>0001-01-01</ParDt> ze względu na formalną konieczność podania tej daty.

```
<trar.rcn.001.03>
  <GnlInf>
    .....
    <ParDt>0001-01-01</ParDt>
    .....
    <Lnk>
      <UnqTradIdr> UTI0123456789</UnqTradIdr>
      <RptgCtrPtyId>LEI_1</RptgCtrPtyId>
      <OthrCtrPtyId>LEI_2</OthrCtrPtyId>
    </Lnk>
  </GnlInf>
  <Sts>
    <StsCd>NPAR</StsCd>
    <Rsn>
      <RsnCd>XXXX</RsnCd>
    </Rsn>
  </Sts>
</trar.rcn.001.03>
```

C. W przypadku pełnej zgodności raportów obu stron kontraktu wysyłany jest następujący przykładowy komunikat:

```
<trar.rcn.001.03>
  <GnlInf>
    <SndrMsgRef>00000000</SndrMsgRef>
    <RepTmStmp>2020-06-24T18:05:18.3781253Z</RepTmStmp>
    <ParDt>2020-06-24</ParDt>
    <CompDt>2020-06-24</CompDt>
    <EligDt>2020-06-22</EligDt>
    <Lnk>
      <UnqTradIdr>UTI0123456789</UnqTradIdr>
      <RptgCtrPtyId>LEI_1</RptgCtrPtyId>
      <OthrCtrPtyId>LEI_2</OthrCtrPtyId>
    </Lnk>
  </GnlInf>
```


RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.3	Product classification type	C = CFI U = UPI	Exact match	2
2.4	Product classification	ISO 10692 CFI, 6 characters alphabetical code Endorsed UPI	First 2 characters of CFI code must match	2
2.5	Product identification type	Specify the applicable identification: I = ISIN A = All	Exact match	1
2.6	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)	Must match if field 2.5 is ISIN.	1
2.7	Underlying identification type	I = ISIN A = All U = UPI B = Basket X = Index	Exact match	1

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.8	Underlying identification	<p>For underlying identification type I: ISO 6166 ISIN 12 character alphanumeric code</p> <p>For underlying identification type A: complete All code in accordance with Article 4(8)</p> <p>For underlying identification type U: UPI</p> <p>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 "-".</p> <p>For underlying identification type X: ISO 6166 ISIN if available, otherwise full name of the index as assigned by the index provider</p>	<p>Exact match</p> <p>Must match where Underlying identification type = I, U, NA, or X. Do not reconcile where Underlying identification type=B or A".</p> <p>TDD Generation -</p> <p>The population logic of Underlying Identification in TDD file will be as follows:</p> <p>When Underlying Identification Type = "X" or "I" and Underlying Identification is ISIN (Identified by exact 12 alphanumeric characters), then populate value for Underlying Identification.</p> <p>When Underlying Identification Type = "X" or "I" and Underlying Identification is NOT ISIN (Identified by string length NOT 12 characters), then DO NOT populate value for Underlying Identification in TDD file.</p>	1
2.9	Notional currency 1	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits.	Exact match	1
2.10	Notional currency 2	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits.	Exact match	2
2.11	Deliverable currency	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits.	Do not compare	3
2.12	Trade ID	<p>Until global UTI is available, up to 52 alphanumeric character code including four special characters: . - _ :</p> <p>Special characters are not allowed at the beginning and at the end of the code. No space allowed.</p> <p>Note: the RTS allows . - _ . (full stop, hyphen, underscore and full stop again).</p>	Exact match	1

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.13	Report tracking number	An alphanumeric field up to 52 characters	Do Not Compare	3
2.14	Complex trade component ID	An alphanumeric field up to 35 characters	Do not Compare	3
2.15	Venue of execution	ISO 10383 Market Identifier Code (MIC), 4 digits alphabetical. Where relevant, XOFF for listed derivatives that are traded off-exchange or XXXX for OTC derivatives.	Exact Match	2
2.16	Compression	Y = if the contract results from compression; N= if the contract does not result from compression.	Exact Match	2
2.17	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"	Field specific rule Apply tolerance rule 1, to both absolute value or reciprocal.	2
2.18	Price notation	U = Units P = Percentage Y = Yield	Exact match	1
2.19	Currency of price	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetic characters	Exact match	1
2.20	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.	Apply tolerance check 2.	1
2.21	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.	Apply tolerance check 1.	1

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.22	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.	Exact match	1
2.23	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.	Do not compare	3
2.24	Delivery type	C=Cash, P=Physical, O=Optional for counterparty.	Exact match	2
2.25	Execution timestamp	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	Field Specific Rule Apply tolerance check 3.	2
2.26	Effective date	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	Exact match	2
2.27	Maturity date	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	Exact match	1
2.28	Termination date	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	Exact match	2
2.29	Settlement date	ISO 8601 date format. Note that RTS defines this as date of settlement of the <u>underlying</u>	Do Not Compare	3
2.30	Master Agreement type	Free Text, field of up to 50 characters, identifying the name of the Master Agreement used, if any.	Do Not Compare	3
2.31	Master Agreement version	ISO 8601 date in the format YYYY	Do Not Compare	3
2.32	Confirmation timestamp	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	Only reconcile where Confirmation Means = E or N Apply tolerance check 4.	2
2.33	Confirmation means	Y=Non-electronically confirmed, N=Non-confirmed, E=Electronically confirmed.	Exact match	2
2.34	Clearing obligation	Y = Yes N = No X = NA	Exact match	2
2.35	Cleared	Y=Yes, N=No.	Exact match	1

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.36	Clearing timestamp	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	Apply tolerance check 4.	2
2.37	CCP	ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) 20 alphanumeric character code.	Exact match	2
2.38	Intragroup	Y=Yes, N=No.	Exact match	2
2.39	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.	Sort values based on Fixed Rate in ascending order and perform comparison	2
2.40	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 character. If populated, it shall be represented by a dot. The negative symbol, if populated, is not counted as a numerical character.	Sort values based on Fixed Rate in ascending order and perform comparison	2
2.41	Fixed rate day count leg 1	Actual/365, 30B/360 or Other.	Do Not Compare	3
2.42	Fixed rate day count leg 2	Actual/365, 30B/360 or Other.	Do Not Compare	3
2.43	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	Do Not Compare	3
2.44	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.	Do Not Compare	3
2.45	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	Do Not Compare	3
2.46	Fixed rate payment frequency leg 2 - multiplier	Integer multiplier of the time period describing how often the counterparties exchange payments. Up to 3 numerical characters.	Do Not Compare	3

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.47	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	Do Not Compare	3
2.48	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.	Do Not Compare	3
2.49	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	Do Not Compare	3
2.50	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.	Do Not Compare	3
2.51	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	Do Not Compare	3
2.52	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.	Do Not Compare	3
2.53	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	Do Not Compare	3
2.54	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.	Do Not Compare	3

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.55	Floating rate of leg 1	'EONA' – EONIA '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	Do Not Compare	3
2.56	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	Do Not Compare	3
2.57	Floating rate reference period leg 1 – multiplier	Integer multiplier of the time period describing the reference period. Up to 3 numerical characters.	Do Not Compare	3
2.58	Floating rate of leg 2	'EONA' – EONIA '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	Do Not Compare	3
2.59	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	Do not compare	3
2.60	Floating rate reference period leg 2 – multiplier	Integer multiplier of the time period describing the reference period. Up to 3 numerical characters.	Do not compare	3

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.61	Delivery currency 2	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits or 'XXX'	Do not compare	3
2.62	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.	Apply tolerance check 1.	2
2.63	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.	Apply tolerance check 1.	2
2.64	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.	Direct comparison on string value	2
2.65	Commodity base	AG = Agricultural EN = Energy FR = Freights ME = Metals IN = Index EV = Environmental EX = Exotic OT = Other	Exact match	1
2.66	Commodity details	<u>Agricultural</u> GO = Grains oilseeds DA = Dairy LI = Livestock FO = Forestry SO = Softs SF = Seafood OT = Other <u>Energy</u> OI = Oil NG = Natural gas CO = Coal EL = Electricity IE = Inter-energy OT = Other <u>Freights</u> DR = Dry WT = Wet OT = Other <u>Metals</u> PR = Precious NP = Non-precious <u>Environmental</u> WE = Weather EM = Emissions OT = Other	Exact match	2

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.67	Delivery point or zone	EIC code, 16 character alphanumeric code. Repeatable field.	Do not compare	3
2.68	Interconnection point	EIC code, 16 character alphanumeric code.	Do not compare	3
2.69	Load type	BL = Base Load PL = Peak Load OP = Off-Peak BH = Hour/Block Hours SH = Shaped GD = Gas Day OT = Other	Do not compare	3
2.70	Load delivery intervals	hh:mmZ	Do not compare	3
2.71	Delivery start date and time	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	Do not compare	3
2.72	Delivery end date and time	ISO 8601 date in the UTC time format YYYY-MM-DDThh:mm:ssZ	Do not compare	3
2.73	Duration	N=Minutes H= Hour D= Day W=Week M=Month Q = Quarter S= Season Y= Annual O=Other	Do not compare	3
2.74	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	Do not compare	3

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.75	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.	Do not compare	3
2.76	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	Do not compare	3
2.77	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.	Do not compare	3
2.78	Option type	P = Put C = Call O = where it cannot be determined whether it is a call or a put	Exact match	1
2.79	Option exercise style	A = American B = Bermudan E = European S = Asian More than one value is allowed	Exact match	2

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.80	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"	Apply tolerance check 1.	1
2.81	Strike price notation	U = Units P = Percentage Y = Yield	Exact match	1
2.82	Maturity date of the underlying	ISO 8601 date in the format YYYY-MM-DD	Exact match	1
2.83	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 Y	Exact match	2
2.84	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	Exact match	2
2.85	Frequency of payment	MNTH = Monthly QURT = Quarterly MIAN = Semi-annually YEAR = Yearly	Exact match	2
2.86	The calculation basis	Numerator/Denominator where both, Numerator and Denominator are numerical characters or alphabetic expression 'Actual', e.g. 30/360 or Actual/365	Do not compare	3

RTS Field	RTS Name	ESMA Level 2 Format	Match/ Tolerance Rule to other trade	Category
2.87	Series	Integer field up to 5 characters	Exact match	2
2.88	Version	Integer field up to 5 characters	Exact match	2
2.89	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.	Apply tolerance check 1.	2
2.90	Tranche	T=Tranched U=Untranched	Exact match	2
2.91	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.	Apply tolerance check 1.	2
2.92	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.	Apply tolerance check 1.	2
2.93	Action type	N = New M = Modify E = Error C = Early Termination R = Correction Z = Compression V = Valuation update P = Position component	Do not compare	3
-	-	Inter-TR status: E = Error M = Modified data, rerun reconciliation request R = Reconciliation request X = Pairing removal	Special rules defined in the <i>Process TDD files from other TRs</i> section.	3
2.94	Level	T = Trade P = Position	Exact match	1

V.2. Załącznik 2 – Lista kodów wyników procesu rekonyliacji.

Lista możliwych kodów (RsnCd) wyników porównania oraz statusów raportów (StsCd):

Status Code (StsCd)	Reason Code (RsnCd)	Reason Text (RsnTxt)
MACH	XXXX	Trade reconciled correctly
NPAR	XXXX	Trade not paired
ERCD	CPCT	Value in field Subject to EMIR obligation inconsistent with other counterparty report
ERCD	ERL1	Invalid LEI in field Reporting Counterparty ID
ERCD	ERL2	Invalid LEI in field ID of the Other Counterparty
ERCD	ERUT	Invalid UTI
ERR1	EASC	Inconsistency in field Asset class
ERR1	ECLR	Inconsistency in field Cleared
ERR1	ECMB	Inconsistency in field Commodity base
ERR1	ECOP	Inconsistency in field Currency of price
ERR1	ECPS	Inconsistency in field Counterparty side
ERR1	ECTP	Inconsistency in field Contract type
ERR1	ELVL	Inconsistency in field Level
ERR1	EMTR	Inconsistency in field Maturity date
ERR1	EMTU	Inconsistency in field Maturity date of the underlying
ERR1	ENC1	Inconsistency in field Notional currency 1
ERR1	ENOT	Inconsistency in field Notional
ERR1	EOTP	Inconsistency in field Option type
ERR1	EPID	Inconsistency in field Product identification
ERR1	EPMT	Inconsistency in field Price multiplier
ERR1	EPNT	Inconsistency in field Price notation
ERR1	EPTP	Inconsistency in field Product identification type
ERR1	EQNT	Inconsistency in field Quantity
ERR1	ESPN	Inconsistency in field Strike price notation
ERR1	ESTP	Inconsistency in field Strike price (cap/floor rate)
ERR1	EUID	Inconsistency in field Underlying identification
ERR1	EUTP	Inconsistency in field Underlying identification type
ERR2	EATP	Inconsistency in field Attachment point
ERR2	ECCP	Inconsistency in field CCP
ERR2	ECLO	Inconsistency in field Clearing obligation
ERR2	ECLT	Inconsistency in field Clearing timestamp
ERR2	ECMD	Inconsistency in field Commodity details
ERR2	ECMP	Inconsistency in field Compression
ERR2	ECNF	Inconsistency in field Confirmation timestamp
ERR2	ECNM	Inconsistency in field Confirmation means
ERR2	EDEL	Inconsistency in field Delivery type
ERR2	EDTP	Inconsistency in field Detachment point

ERR2	EEFF	Inconsistency in field Effective date
ERR2	EERB	Inconsistency in field Exchange rate basis
ERR2	EEXC	Inconsistency in field Execution timestamp
ERR2	EEXR	Inconsistency in field Exchange rate
ERR2	EFER	Inconsistency in field Forward exchange rate
ERR2	EFOP	Inconsistency in field Frequency of payment
ERR2	EFX1	Inconsistency in field Fixed rate leg 1
ERR2	EFX2	Inconsistency in field Fixed rate leg 2
ERR2	EINF	Inconsistency in field Index factor
ERR2	EINT	Inconsistency in field Intragroup
ERR2	ENC2	Inconsistency in field Notional currency 2
ERR2	EOEX	Inconsistency in field Option exercise style
ERR2	EPDC	Inconsistency in field Product classification - 2 first characters
ERR2	EPDT	Inconsistency in field Product classification type
ERR2	EPRT	Inconsistency in field Price / rate
ERR2	EREN	Inconsistency in field Reference entity
ERR2	ESER	Inconsistency in field Series
ERR2	ESNR	Inconsistency in field Seniority
ERR2	ETRM	Inconsistency in field Termination date
ERR2	ETRN	Inconsistency in field Tranche
ERR2	EVER	Inconsistency in field Version
ERR2	EVOE	Inconsistency in field Venue of execution