

**Wersjonowanie danych wg wersji RTS, prezentacja danych i eksport w interfejsie WEB oraz przekazywanie danych w komunikatach zwrotnych trar.sts.001.****Spis treści**

WERSJONOWANIE .....	2
PRZEKAZYWANIE DANYCH W KOMUNIKATACH ZWROTNYCH TRAR.STS.001 .....	2
PREZENTOWANIE DANYCH W INTERFEJSIE WEB .....	3
FORMATKA DO ZGŁASZANIA RAPORTÓW.....	3
EXPORT DANYCH Z ZAKŁADEK ACTIVE I NON-ACTIVE .....	4
ZAŁĄCZNIK .....	5

## Wersjonowanie

W bazie danych KDPW\_TR powołany zostanie znacznik 'RTS version', który będzie przyjmował 2 wartości:

- 1- Dane zgodne z wersją RTS 2014;
- 2- Dane zgodne z wersją RTS 2017.

Znacznik ten nie będzie udostępniany Uczestnikom.

Przyjmuje się następujące założenia:

- zmiana znacznika z 1 na 2 następuje tylko i wyłącznie po przesłaniu pierwszego AT=R, który z założenia zawiera komplet danych obowiązkowych;
- raportowanie AT innych niż M jest możliwe niezależnie od znacznika, tzn. **nie jest konieczne przekazywanie AT=R uzupełniającego dane do nowej struktury RTS dla transakcji i pozycji, do których raportowane są AT inne niż M** (w szczególności możliwe będzie przekazanie AT=C, Z i V do takich transakcji).
- raportowanie AT=M jest możliwe tylko dla znacznika 2 (tzn. po aktualizacji danych za pomocą AT=R).

## Przekazywanie danych w komunikatach zwrotnych trar.sts.001

Struktura danych przekazywane w komunikatach zwrotnych trar.sts.001 zależy będzie od znacznika 'RTS version' i będzie przekazywana zgodnie z następującymi założeniami:

- jeśli znacznik 'RTS version'=2 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2014, to dane przekazujemy komunikatem trar.sts.001.**03**, a dane sekcji Valuation i Collateral mapowane są do nowej struktury zgodnie z Tabelą 1 (załącznik).
- jeśli znacznik 'RTS version'=2 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2017, to wszystkie dane przekazujemy komunikatem trar.sts.001.**03**;
- jeśli znacznik 'RTS version'=1 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2014, to wszystkie dane przekazujemy komunikatem trar.sts.001.**02**;
- jeśli znacznik 'RTS version'=1 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2017, to wszystkie dane przekazujemy komunikatem trar.sts.001.**02** a dane sekcji Valuation i Collateral mapowane są do obecnej struktury zgodnie z Tabelą 2 (załącznik).

W odpowiedzi na komunikat zawierający zgłoszenie do raportów obowiązujących zarówno w nowej jak i w starej strukturze, uczestnik otrzyma 2 komunikaty: komunikat trar.sts.001.**03** jako odpowiedź i przekazanie informacji o danych zapisanych w bazie RT dla raportów, dla których znacznik 'RTS version' jest równy 2 oraz komunikat trar.sts.001.**02** jako odpowiedź i przekazanie informacji o danych zapisanych w bazie RT dla raportów, dla których znacznik 'RTS version' jest równy 1. Analogicznie obsługiwane będą komunikaty przepytujące trar.rqs.001.

## Prezentowanie danych w interfejsie WEB

Zakłada się, że zakładki Active i Non-active reports zostaną dostosowane tak, aby siatka pokazująca dane zawierała następujące informacje:

Nazwa	Obecna nazwa
Unique Trade Identifier	TID
Report tracking number	TRN
Level	-
Action Type	AT
Report submitting entity	RE RT ID
Reporting Counterparty	CP RT iD
ID of the Other Counterparty	Other CP RT iD
Venue of Execution	VoE
Execution timestamp	Exc timestamp
Termination date*	Termination date

\*pole dostępne tylko w zakładce Non-Active

Zakładka Deleted reports pozostaje bez zmian.

Po wybraniu konkretnego raportu w zakładkach Active i Non-active uczestnik będzie miał możliwość wyświetlenia szczegółów raportu w okienku 'View'. Dane wyświetlane w widoku View będą zależne od znacznika 'RTS version', zgodnie z poniższymi założeniami:

- jeśli znacznik 'RTS version'=2 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2014, to dane wyświetlane są w nowej wersji widoku, a dane sekcji Valuation i Collateral mapowane są do nowej struktury zgodnie z poniższą Tabelą 1 (załącznik);
- jeśli znacznik 'RTS version'=2 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2017, to wszystkie dane wyświetlane są w nowej wersji widoku;
- jeśli znacznik 'RTS version'=1 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2014, to wszystkie dane przekazujemy przy użyciu obecnej wersji widoku View;
- jeśli znacznik 'RTS version'=1 a sekcje Valuation i Collateral zawierają dane w strukturze 2017, to wszystkie dane przekazujemy przy użyciu obecnej wersji widoku View, a dane sekcji Valuation i Collateral mapowane są do obecnej struktury zgodnie z poniższą Tabelą 2 (załącznik).

### Formatka do zgłaszania raportów

Od momentu wdrożenia dostępna będzie tylko i wyłącznie formatka pozwalająca na raportowanie danych w nowym formacie. Oznacza to, że w formatkach poszczególnych AT dla danych zgodnych z obecną strukturą widoczne będą tylko dane, które można zmapować do nowej struktury, natomiast pola obowiązujące od nowych RTS będą puste. Dotyczy to wszystkich AT.

**Export danych z zakładek Active i Non-active**

Struktura pliku eksportowanego z zakładek Active i non-active będzie obejmować pola obu wersji RTS. W przypadku, kiedy uczestnik eksportuje dane o raportach zgłoszonych w strukturze 2014 jak i w 2017 jednocześnie, otrzyma plik, w którym wartość pól będzie przekazywana zgodnie z wersją RTS, tzn. dla każdego raportu zgłoszonego w wersji 2014 pola obowiązujące od wersji 2017 będą puste, a dla każdego raportu zgłoszonego w wersji 2017 pola wycofane w wersji 2017 będą puste.

**Załącznik**
**Tabela 1**

RTS 2014	RTS 2017
Currency of mark to market value of the contract	Currency of the value
Valuation date	Data z pola Valuation timestamp
Valuation time	Czas z pola Valuation timestamp
Valuation type	Valuation type
Collateralization	Collateralisation
Collateral portfolio	Collateral portfolio
Collateral portfolio code	Collateral portfolio code
Value of the collateral	Initial margin posted
Currency of the collateral value	Currency of the initial margin posted

**Tabela 2**

RTS 2017	RTS 2014
Currency of the value	Currency of mark to market value of the contract
Valuation timestamp	Valuation date
Valuation timestamp	Valuation time
Valuation type	Valuation type
Collateralisation	Collateralization
Collateral portfolio	Collateral portfolio
Collateral portfolio code	Collateral portfolio code
Initial margin posted	Value of the collateral
Currency of the initial margin posted	Currency of the collateral value
Variation margin posted	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Currency of the variation margin posted	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Initial margin received	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Currency of the initial margin received	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Variation margin received	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Currency of the variation margin received	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Excess collateral posted	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Currency of the excess collateral posted	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Excess collateral received	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R
Currency of the excess collateral received	nie przekazywane do momentu przekazania AT=R