

Materiał informacyjny dotyczący przepływu komunikatów w KDPW_TR dla transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.

Data	Wersja	Autor	Opis
18.04.2019	1.0	KDPW_TR	Powstanie dokumentu
12.12.2019	1.1	KDPW_TR	Dodanie rozdziału 2.2 Komunikat statusowy, rozbudowanie słownika pojęć, aktualizacja nazw komunikatów ISO 200022, aktualizacja rozdziału 3.

Spis treści

1.	Słownik pojęć.....	2
2.	Komunikaty.....	4
2.1.	Rodzaje komunikatów	4
2.2.	Komunikat statusowy – budowanie referencji do komunikatów wejściowych	4
3.	Przepływy komunikatów podczas raportowania detali związanych z transakcjami SFT.....	6
3.1.	Raportowanie detali transakcji.....	6
3.2.	Rekoncyliacja	6
3.3.	Komunikat notyfikacyjny (dwóch uczestników raportujących).....	7
3.4.	Komunikat notyfikacyjny (jeden uczestnik raportujący)	7
3.5.	Raporty końca dnia.....	8

1. Słownik pojęć

KDPW_TR - usługa repozytorium transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (zwanymi dalej SFT) oferowana przez KDPW

Podmiot raportujący - Podmiot przekazujący raporty w ramach wymogów określonych przez Rozporządzenie SFTR (z ang. Securities Financing Transaction Regulation; nr 2015/2365 z dn. 25 listopada 2015 r.)

Rozporządzenie SFTR (ang. securities financing transactions and of reuse) – Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012

Repozytorium – organizowane i prowadzone przez KDPW S.A. Repozytorium Transakcji dla transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych prowadzone zgodnie z rozporządzeniem SFTR

RC – strona transakcji SFT

RC – Reporting Counterparty – podmiot zawierający transakcje SFT zobowiązany do raportowania,

RSE – podmiot składający raport

ERR – podmiot odpowiedzialny za raportowanie

LEI – Legal Entity Identifier - unikalny identyfikator podmiotu zgodny z normą ISO17442,

Uczestnik - podmiot nawiązujący z KDPW S.A. umowę o uczestnictwo w Repozytorium

Transakcja SFT– transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych (SFT), o której mowa w art. 3 pkt 11 Rozporządzenia 2015/2365, podlegająca obowiązkowi zgłoszenia do repozytorium transakcji

Raport – zgłoszenie do Repozytorium szczegółowych informacji dotyczących zawarcia, zmiany lub zakończenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, a także zgłoszenia lub zmiany depozytu zabezpieczającego i ponownego wykorzystania zabezpieczenia (ReUse)

Regulamin – Regulamin SFTR KDPW_TR - REGULAMIN REPOZYTORIUM TRANSAKCJI DLA TRANSAKCJI FINANSOWANYCH Z UŻYCIEM PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH. Przyjęty uchwałą Rady Nadzorczej KDPW nr 49/817/19 z dnia 11 października 2019 r. Obowiązujący od 12 grudnia 2019r.

2. Komunikaty

2.1. Rodzaje komunikatów

Komunikaty dziedzinowe wykorzystywane w procesie raportowania transakcji SFT w relacji z Podmiotami raportującymi:

- auth.052.001.01 - komunikat służący do składania raportów o detalach transakcji SFT;
- auth.070.001.01 - komunikat służący do składania raportów o depozytach zabezpieczających;
- auth.071.001.01 - komunikat służący do składania raportów o ponownym wykorzystaniu zabezpieczenia;
- auth.031.001.01 – komunikat statusowy do komunikatów auth.052.001.01; auth.070.001.01; auth.071.001.01;
- auth.080.001.01 - komunikat statusowy z informacją zwrotną dotyczącą procesu rekoncyliacji
- auth.rlt.001.01 –komunikat własny KDPW, służący do realizowania obowiązku definiowania relacji między RSE a RC w bazach systemu KDPW_TR, o którym mowa w § 12 ust. 6 Regulaminu;
- auth.ntf.001.01 - komunikat własny KDPW służący do komunikacji z Uczestnikami Repozytorium

2.2. Komunikat statusowy – budowanie referencji do komunikatów wejściowych

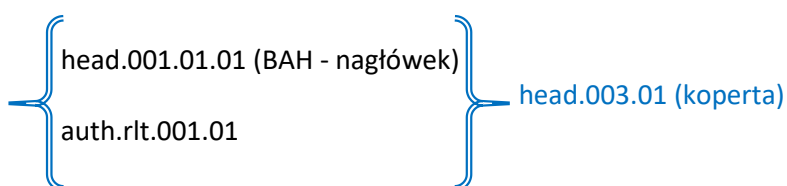
Zgodnie z zasadami przekazywania komunikatów zgodnych z ISO 20022 wszystkie komunikaty kierowane do systemu repozytorium SFTR muszą być opatrzone nagłówkiem i kopertą.

Na plik składają się opakowane w kopertę (komunikat head.003):

- a. Nagłówek: Business Application Header – head.001.001.01,
- b. Komunikat dziedzinowy.

Na potrzeby robocze plik będzie nazywany zgodnie z nazwą komunikatu dziedzinowego.

Przykładowy plik:



W usłudze SFTR pliki (komunikaty) należy kierować do odbiorcy 0001 – kod komunikacyjny SFTR KDPW_TR.

W odpowiedzi na komunikat wejściowy KDPW_TR zwrotnie przekazywał będzie komunikat statusowy auth.031.01. Relacja do pliku wejściowego budowana będzie w następujący sposób:

- W przypadku niezgodności ze schemą pliku wejściowego lub błędnej nazwy pliku, w komunikacie statusowym w:

- o nagłówku (head.001.001.01) w sekcji **Related**, w tag-u **BizMsgIdr** znajdzie się identyfikator zbudowany zgodnie z poniższym algorytmem:

< BizMsgIdr> 123456789</ BizMsgIdr>

gdzie:

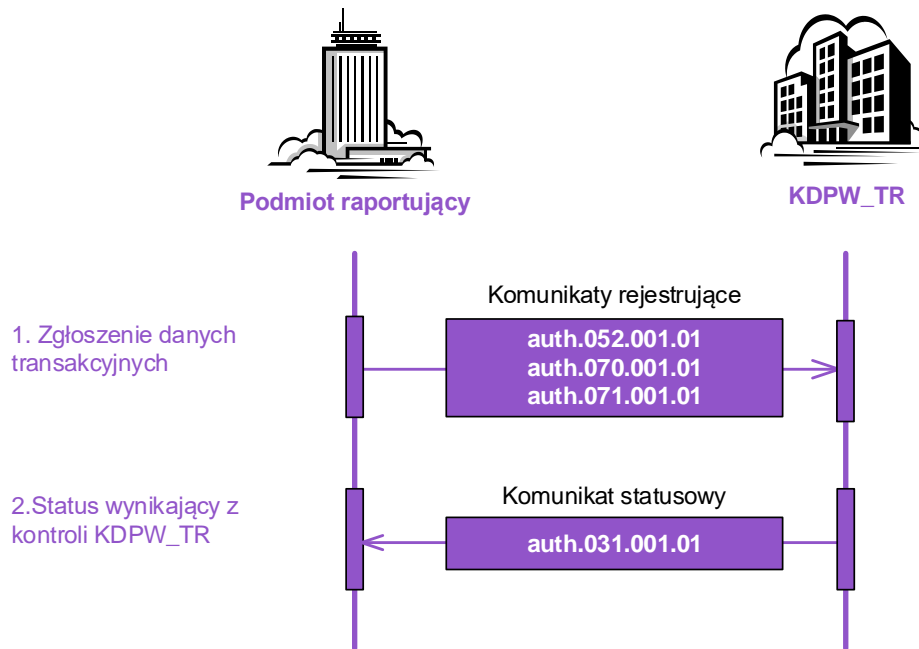
- 123456789 – numer nadany przez Menedżer MQ udostępniany nadawcy komunikatu wejściowego.

Dodatkowo w tej samej sekcji w tagu **CreDt** znajdzie się również stempel czasowy – data przyjęcia komunikatu od uczestnika,

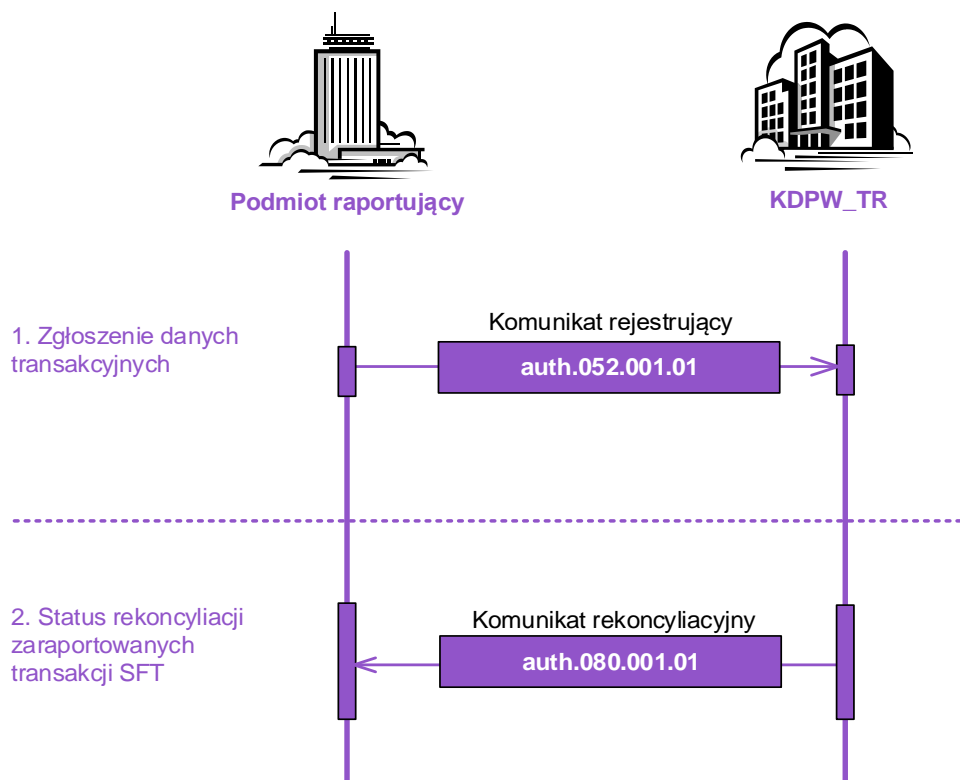
- o komunikacie auth.031.01.01 w sekcji **StsAdv** -> **MsgSts** -> **RptSts** (status wiadomości) zwrócony zostanie status 'CRPT' – Corupted File.
- W przypadku błędu autoryzacji w odwołaniu do identyfikatora umieszczonego w BAH komunikatu wejściowego w:
 - o nagłówku (head.001.001.01) w sekcji **Related**, w tag-u **MsgDflr** znajdzie się identyfikator przekazany w pliku wejściowym w **To**, w tag-u **BizMsgIdr**
 - o komunikacie auth.031.01.01 w sekcji **StsAdv** -> **MsgSts** -> **RptSts** (status wiadomości) zwrócony zostanie status 'RJCT' – Rejected oraz podana zostanie przyczyna odrzucenia.
- W przypadku przekazania prawidłowego formalnie pliku, komunikat statusowy budowany jest w następujący sposób:
 - o w nagłówku (head.001.001.01) w sekcji **To**, w tag-u **BizMsgIdr** znajdzie się identyfikator przekazany w pliku wejściowym w **From**, w tag-u **BizMsgIdr**
 - o w komunikacie auth.031.01.01 w sekcji **StsAdv** -> **MsgSts** -> **RptSts** (status wiadomości) zwrócony zostanie status 'ACPT' (Accepted) lub 'RJCT' oraz podana zostanie statystyka rekordów zaakceptowanych lub odrzuconych
 - o w komunikacie auth.031.01.01 w sekcji **RcrdSts** – status rekordu, w tag-u:
 - **OrgnlRcrdId** wskazywany jest TechnicalRecordId podany w komunikacie wejściowym.
 - **Sts** – status wynikający z kontroli merytorycznej komunikatu dziedzinowego
 - **ValtnRule** – przyczyna odrzucenia w przypadku statusu RJCT

3. Przepływy komunikatów podczas raportowania detali związanych z transakcjami SFT.

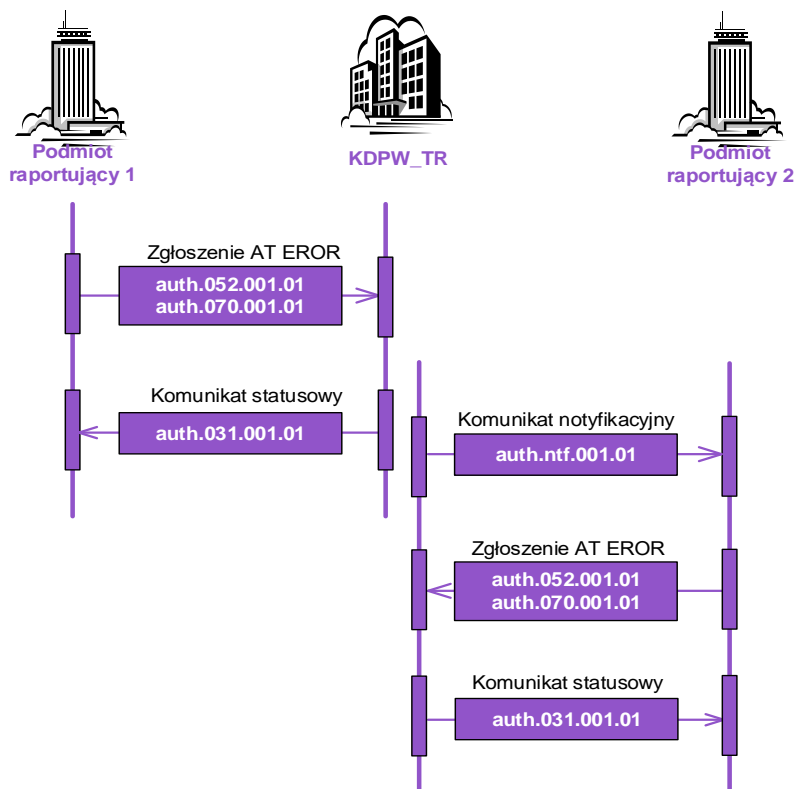
3.1. Raportowanie detali transakcji



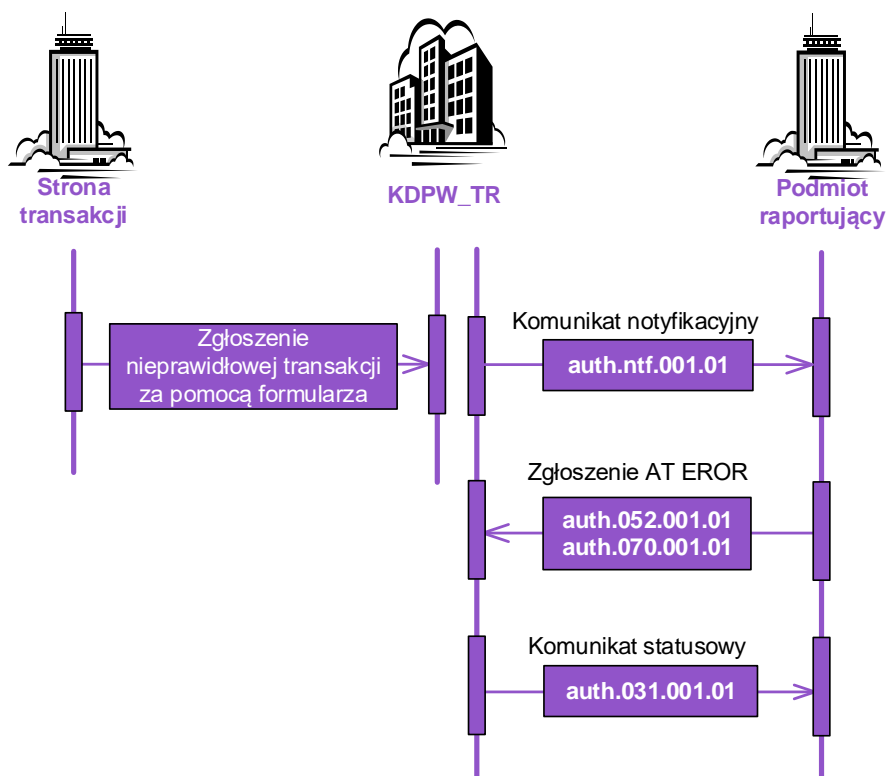
3.2. Rekoncyliacja



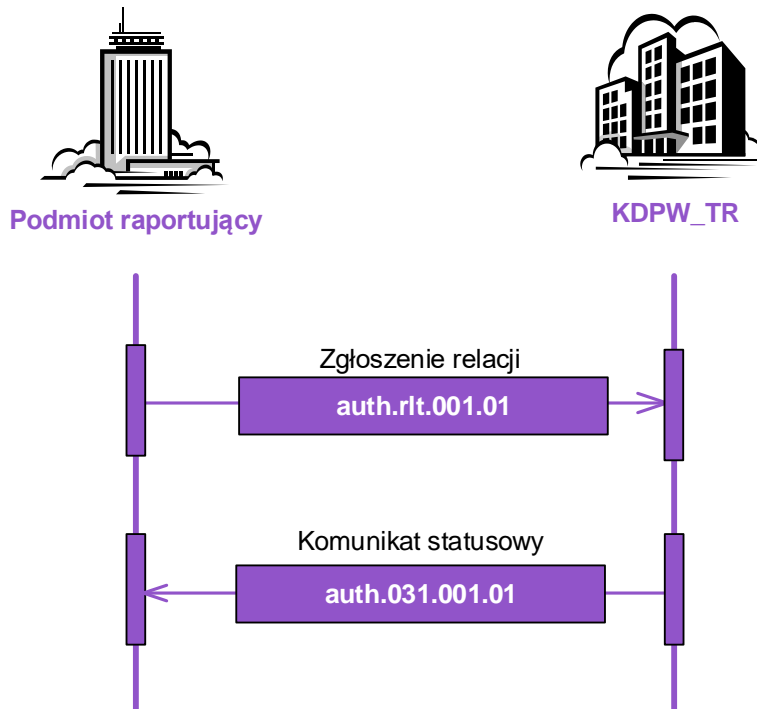
3.3. Komunikat notyfikacyjny (dwóch uczestników raportujących)



3.4. Komunikat notyfikacyjny (jeden uczestnik raportujący)



3.5. Definiowanie relacji w bazach Repozytorium



3.6. Raporty końca dnia

