

Materiał informacyjny dotyczący systemu do obsługi zatwierdzonego mechanizmu sprawozdawczego (ARM - Approved Reporting Mechanism) KDPW_ARM**Spis treści**

Historia Zmian	2
Słownik pojęć	2
1. Cel usługi ARM	4
2. Zarys działania usługi ARM	5
3. Tryby raportowania	5
4. Identyfikacja FI w usłudze ARM	6
5. Schemat przepływu komunikatów w usłudze ARM	6
6. Kontrole merytoryczne raportów o transakcjach rejestrowanych w bazach ARM	9
7. Raportowanie w trybie uproszczonym	9
8. Raportowanie w trybie bezpośrednim	16
9. Raportowanie delegowane	16
10. Wymagane dane osobowe	16
11. Raportowanie przez ARM do Nadzorców	18
12. Opłaty	22

Historia Zmian

Historia zmian

DATA AKTUALIZACJI	WERSJA	OPIS
17.05.2017	1.	Powstanie dokumentu
15.09.2017	2	Aktualizacja materiału w związku z: - powołaniem komunikatu statusowego auth.str.001.01, - wycofanie się ze stosowania auth.016 i auth.031 w komunikacji w ramach składania raportów przez uczestników KDPW_ARM, - powołaniem statusów własnych KDPW_ARM. - aktualizacją diagramów.
28.09.2017	3	Aktualizacja materiału w związku z: - dodaniem informacji o rozszerzeniu trybu uproszczonego o BondSpot i Treasury BondSpot, - dodaniem nowego kodu statusu ARCC, - dodaniem nowych reguł budowania komunikatów w trybie uproszczonym (w zakresie podejmującego decyzję w imieniu kupującego/sprzedającego), - dodaniem informacji o mechanizmie wyznaczania stron transakcji rynkowych, - modyfikacja zapisów związanych z transsmiting firm (w trybie uproszczonym).
14.11.2017	4	Aktualizacja materiału w związku z: - powołaniem Regulaminu ARM, - aktualizacją załączników, - powołaniem dokumentu Materiał informacyjny – Kontrole merytoryczne w systemie KDPW_ARM, - rozszerzeniem zastosowania statusu ARWR .
28.04.2024	5	Aktualizacja materiału w związku z usunięciem możliwości raportowania w trybie RT (po wdrożeniu EMR REFIT).

Słownik pojęć

FI – firma inwestycyjna zobowiązana do zgłaszania transakcji zgodnie z art. 26 rozporządzenia MIFIR

Usługa ARM – oferowana przez KDPW, jako zatwierdzony mechanizm sprawozdawczy, o którym mowa w art. 4 ust. 1 pkt 54 MIFID II (Approved Reporting Mechanism, ARM) usługa polegająca na zgłaszaniu szczegółów transakcji właściwym organom lub ESMA w imieniu FI

Regulamin ARM – regulamin usługi opublikowany 13 listopada 2017r. określający zasady prowadzenia usługi oraz prawa i obowiązki KDPW i uczestnika KDPW_ARM.

EMIR - Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) Nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji

MIFIR - Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) Nr 600/2014 Z Dnia 15 Maja 2014 r. w Sprawie Rynków Instrumentów Finansowych oraz Zmieniające Rozporządzenie (EU) Nr 648/2012

MIFID II - Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych oraz zmieniająca dyrektywę 2002/92/WE i dyrektywę 2011/61/UE

ESMA – European Securities and Markets Authority

RTS 22 – Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2017/590 z dnia 28 lipca 2016 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących zgłaszania transakcji właściwym organom.

Tabela 2 do RTS 22 – Tabela 2 załącznika 1 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2017/590 z dnia 28 lipca 2016 r. uzupełniającego rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 600/2014 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących zgłaszania transakcji właściwym organom.

SHORTCODE - identyfikator wykorzystywany w zleceniach rynkowych i raportach przekazywanych bezpośrednio do KDPW przez FI do oznaczenia stron zawierających transakcję (kupujący, sprzedający) oraz innych podmiotów/osób występujących w raportach w polach: osoba podejmująca decyzję w imieniu kupującego/sprzedającego, decyzja inwestycyjna wewnątrz firmy, wykonanie wewnątrz firmy.

Uczestnik - Podmiot będący stroną zawartej umowy z KDPW dot. usługi ARM. Wyróżnia się:

- Uczestnika podstawowego. Podmiot, który zawarł z Krajowym Depozytem umowę o uczestnictwo w systemie ARM, zobowiązany do zgłaszania właściwemu organowi nadzoru szczegółów transakcji zawartych w instrumentach finansowych
- Reprezentanta. Podmiot, który zawarł z Krajowym Depozytem umowę o uczestnictwo w systemie ARM, przekazujący komunikaty do systemu ARM w imieniu uczestnika podstawowego ARM.

Nadzorca - organ powołany przez każde państwo członkowskie zgodnie z art. 67 MIFID II

FIRDS - Financial Instrument Reference Data System

RT – usługa repozytorium transakcji oferowana przez KDPW

Raport - zgłoszenie lub anulowanie informacji o transakcji zawierające dane określone w tabeli 2 do RTS 22

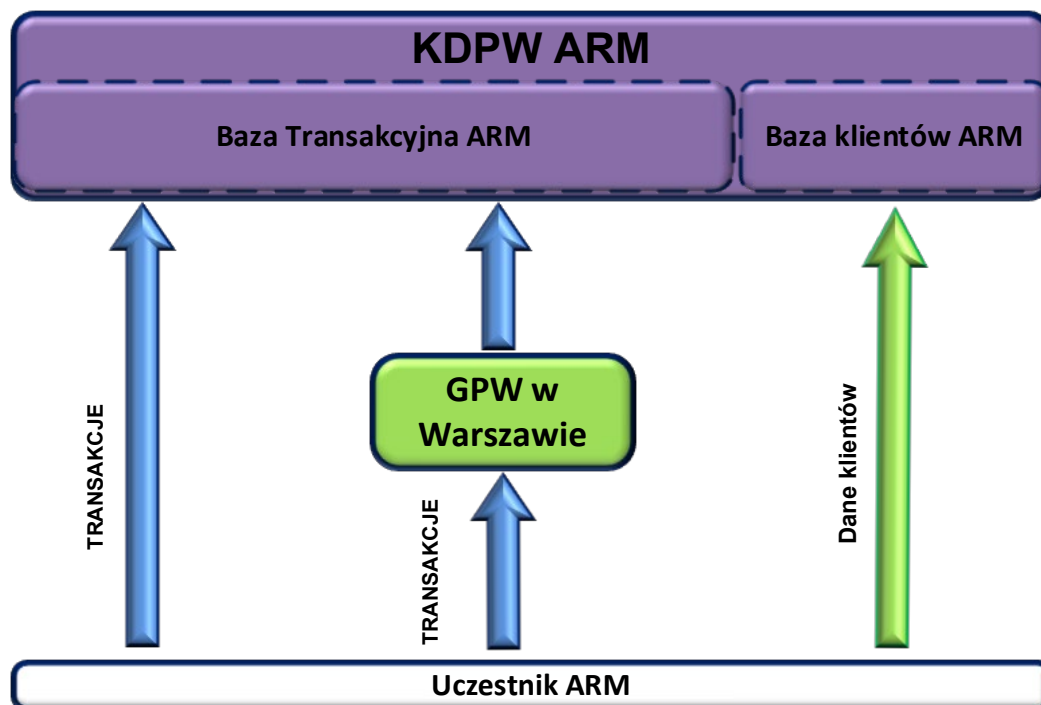
1. Cel usługi ARM

Celem usługi ARM jest umożliwienie firmom inwestycyjnym wywiązania się za pośrednictwem KDPW z obowiązku zgłaszania transakcji, o którym mowa w art. 26 MIFIR. Zgodnie z Rozporządzeniem (EU) 2016/1033 z dnia 23 czerwca 2016 roku zmieniającym Rozporządzenie MIFIR, obowiązek ten ma zastosowanie od dnia 3 stycznia 2018 r.

Raporty o transakcjach zawartych w dniu T powinny być przekazane do Nadzorca najpóźniej do końca dnia T+1. Szczegółowe zasady przekazywania raportów określa Regulamin ARM. Baza instrumentów finansowych publikowana przez ESMA, tzw. FIRDS określa zakres instrumentów, które podlegają obowiązkowi zgłaszania do Nadzorca. Jest ona tworzona na podstawie danych (dot. instrumentów finansowych notowanych w systemach obrotu oraz indeksów) otrzymywanych poprzedniego dnia, od Nadzorca w danej jurysdykcji. Jako podlegające obowiązkowi raportowania kwalifikowane są więc transakcje zawarte w instrumentach publikowanych na liście FIRDS lub w instrumentach opartych o instrument bazowy, którym jest instrument publikowany na liście FIRDS. KDPW nie będzie dokonywać kontroli w zakresie kwalifikacji transakcji objętych obowiązkiem raportowania. Kontrola taka, zgodnie z przyjętymi założeniami powinna zostać zapewniona przez Nadzorcę, w okresie 7 dni kalendarzowych od dnia otrzymania raportu. Oznacza to, że KDPW – w imieniu FI - przekaże Nadzorca wszystkie raporty, które zbuduje na podstawie odebranych komunikatów o transakcjach, niezależnie od instrumentu będącego przedmiotem transakcji. Szczegółowy zakres kontroli merytorycznych wykonywanych w momencie odbierania komunikatów od uczestników KDPW_ARM określa Materiał informacyjny – Kontrole merytoryczne w systemie KDPW_ARM.

2. Zarys działania usługi ARM

2.1 Schemat usługi ARM



2.2 Funkcjonalności usługi ARM

- Odbieranie i przechowywanie raportów o transakcjach składanych przez FI;
- Przeprowadzanie kontroli formalnych i merytorycznych otrzymanych raportów;
- Budowanie raportów na podstawie danych transakcyjnych z rynków;
- Przekazywanie raportów do Nadzorczy;
- Przekazywanie FI kopii raportu przekazanego do Nadzorczy;
- Informowanie o statusie raportu nadanym przez Nadzorcę oraz o statusie raportu po przeprowadzonych kontrolach: formalnej i merytorycznej.

3. Tryby raportowania

Niezależnie od trybu raportowania korzystanie z usługi ARM możliwe jest wyłącznie po zawarciu umowy z KDPW lub skorzystanie z usług podmiotu pośredniczącego - reprezentanta. Szczegółowe zasady świadczenia usługi określa regulamin ARM.

W ramach usługi ARM funkcjonować będą następujące tryby raportowania:

- I. Tryb Uproszczony
- II. Tryb Bezpośredni

Konfiguracja uczestnika w różnych trybach raportowania będzie możliwa w oparciu o różne kody Instytucji.

3.1. Tryb Uproszczony

W tym trybie raportowane są transakcje zawierane na rynku. Tryb dedykowany wyłącznie dla FI będących członkami GPW, BondSpot lub Treasury BondSpot.

Raportowanie w trybie uproszczonym zostało szerzej omówione w rozdziale nr 7.

3.2. Tryb Bezpośredni

W tym trybie przewiduje się raportowanie bezpośrednie przez FI, tzn. przekazanie pełnej informacji wymaganej w Załączniku 1 do RTS 22 bezpośrednio za pomocą komunikatu do KDPW (kanałem U2A (user to application) bądź A2A (application to application)). Dopuszcza się jednocześnie przekazanie pełnego raportu z danymi osobowymi albo raportu z wykorzystaniem SHORTCODE.

Raportowanie w trybie Bezpośrednim zostało szerzej omówione w rozdziale nr 8.

4. Identyfikacja FI w usłudze ARM

W ramach usługi ARM FI jako osoba prawna oznaczona jest kodem LEI. Zakłada się, że oddziały zagranicznych spółek w celu uzyskania uczestnictwa w usłudze ARM wystąpią o kod LEI, o ile GLEIF¹ umożliwi nadawanie identyfikatorów tym jednostkom.

Jednocześnie dana FI będzie mogła występować jednocześnie pod kilkoma kodami instytucji. W szczególności będą to Instytucje pod kodami występującymi obecnie jako uczestnicy rynków lub uczestnicy RT.

5. Schemat przepływu komunikatów w usłudze ARM

Komunikacja pomiędzy KDPW, a Nadzorcami bazuje na opublikowanych przez ESMA komunikatach ISO20022. Komunikacja ARM z uczestnikami bazuje na komunikatach własnych KDPW (z grupy auth), zgodnych z normą ISO20022.

Uczestnicy usługi ARM mogą przysyłać informacje w trybie Bezpośrednim za pomocą następujących komunikatów:

- auth.rpt.001.01 – komunikat o strukturze odpowiadającej auth.016 rozszerzony o pola umożliwiające przekazywanie kodów SHORTCODE zamiast pełnych danych osobowych. Opcje te są alternatywne, o sposobie raportowania decyduje Uczestnik;
- auth.clt.001.01 – komunikat służący do przekazywania danych dla osób, podmiotów oznaczonych w raportach SHORTCODE.

Uczestnicy bezpośredni KDPW korzystający z trybu uproszczonego (dotyczy uczestników GPW i BondSpot) mogą przekazać dodatkowe informacje do raportów transakcji giełdowych za pomocą poniższych komunikatów:

- auth.clt.001.01 – komunikat służący do przekazywania danych dla osób, podmiotów oznaczonych w raportach SHORTCODE;

¹ GLEIF (Global Legal Entity Identifier Foundation) – organizacja non-profit, będąca jednostką operacyjną Global LEI System, której głównym zadaniem jest zapewnienie integralności operacyjnej Global LEI System.

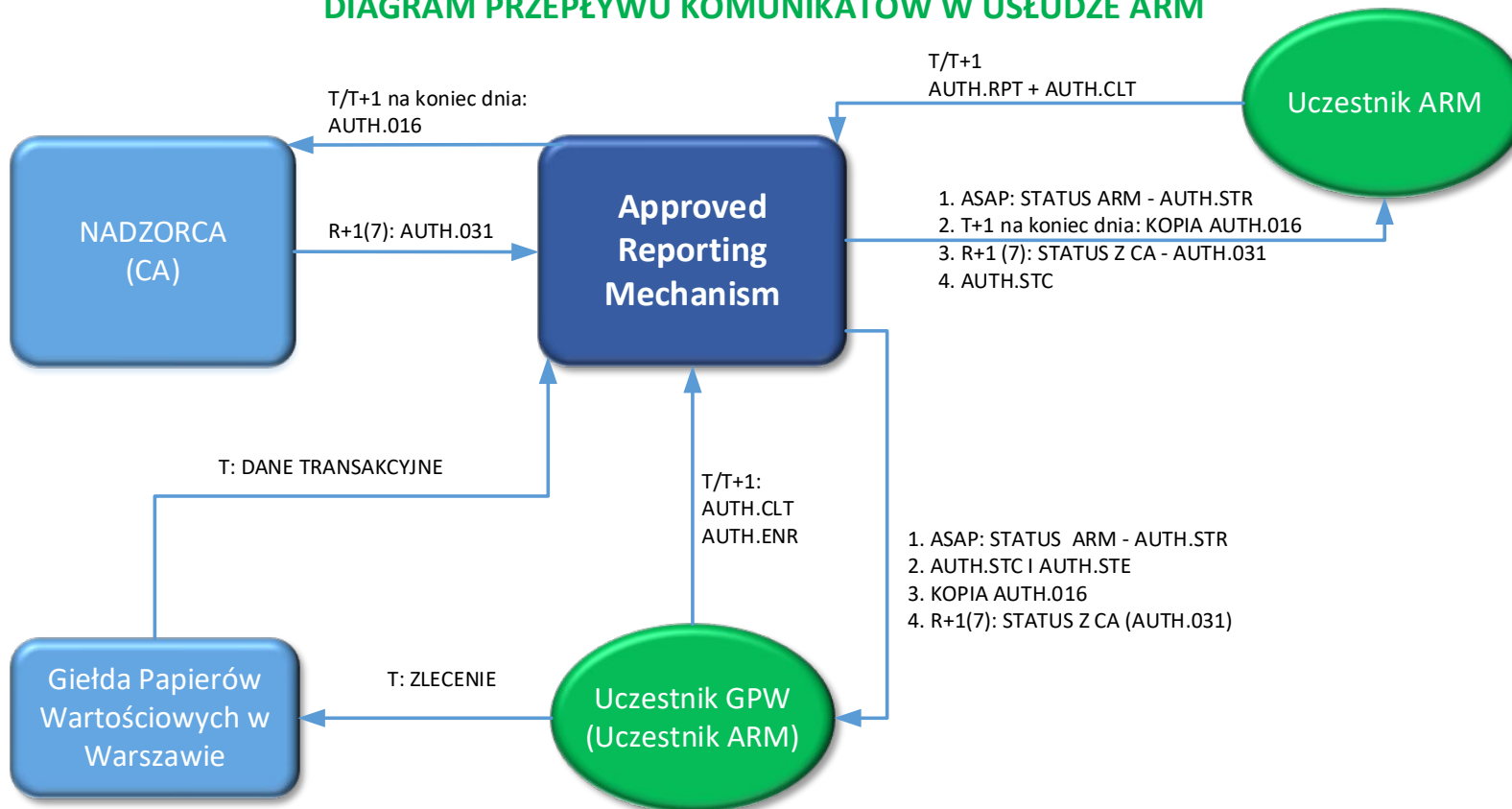
- auth.enr.001.01 - komunikat uzupełniający, służący do przekazania dodatkowych informacji transakcyjnych, które nie występują w systemach GPW/BondSpot/KDPW.

Zbiór komunikatów zwrotnych do Uczestników w usłudze ARM obejmuje:

- auth.str.001.01 - informujący o poprawności raportu bądź ze wskazaniem błędu po przejściu walidacji. Ten sam komunikat będzie wykorzystany również do przekazania statusu raportu otrzymanego od Nadzorca;
- auth.016 – komunikat zwrotny notyfikacyjny do uczestnika usługi ARM zawierający kopię raportu przekazanego do nadzorca (raport do nadzorca będzie wysyłany pod warunkiem jego poprawnego przetworzenia);
- auth.stc.001.01 – komunikat statusowy do komunikatu auth.clr;
- auth.ste.001.01 – komunikat statusowy do komunikatu auth.enr.

Przepływy komunikatów w usłudze ARM zostały szczegółowo opisane w dokumencie *Przepływy komunikatów w systemie ARM KDPW (ARM - Approved Reporting Mechanism)*.

DIAGRAM PRZEPŁYWU KOMUNIKATÓW W USŁUDZE ARM



6. Kontrole merytoryczne raportów o transakcjach rejestrowanych w bazach ARM

Komunikaty przychodzące do KDPW, zgłaszane przez uczestnika usługi ARM w trybie bezpośrednim, a także dane generowane w trybie uproszczonym podlegać będą zdefiniowanym regułom walidacji. Stosuje się 2 poziomy kontroli: kontrole formalne (weryfikacja na poziomie schematu XML) oraz kontrole merytoryczne – zaimplementowane na poziomie oprogramowania przetwarzającego komunikat oraz dane wejściowe.

Kontrole dla komunikatów auth.rpt są zgodne z zasadami walidacji określonymi w dokumencie *Materiał informacyjny – Kontrole merytoryczne w systemie KDPW_ARM*. Dokument ten powstał w oparciu o opublikowane przez ESMA dokumenty: Zasady walidacji oraz auth.016.001.01 ESMAUG Reporting 1.0.2. Ponadto zawiera reguły i kontrole własne KDPW_ARM.

Odstępstwem od reguł walidacji określonych przez ESMA jest reguła sprawdzająca występowanie instrumentu na liście FIRDS. KDPW_ARM waliduje cyfrę kontrolną ISIN. Kontrola zgodności ISIN z listą w bazie referencyjnej ESMA leży wyłącznie w gestii Nadzorca. Dlatego też brak występowania kodu ISIN na liście FIRDS będzie równoznaczny z nadaniem statusu ARWR oraz z brakiem wykonania kontroli, które opierają się na danych referencyjnych instrumentu znajdującego się na liście FIRDS.

KDPW wykonuje kontrole dotyczące następujących obszarów:

- kontrole komunikatów z raportem transakcji (auth.rpt),
- kontrole komunikatów uzupełniających do transakcji rynkowych (auth.enr),
- kontrole komunikatów z danymi klienta (auth.clt).

7. Raportowanie w trybie uproszczonym

7.1. Założenia ogólne

W ramach trybu uproszczonego KDPW zbuduje raporty przesyłane do Nadzorca w oparciu o dane transakcyjne pochodzące z systemów GPW lub BondSpot (w tym Treasury BondSpot).

W tym trybie zakłada się wykorzystanie SHORTCODE jako **niezbędnego** identyfikatora do oznaczania danych osobowych stron zawierających transakcję (kupujący, sprzedający) oraz innych podmiotów/osób występujących w raportach w polach: osoba podejmująca decyzję w imieniu kupującego/sprzedającego, decyzja inwestycyjna wewnątrz firmy, wykonanie wewnątrz firmy. Dane osobowe podmiotu/osoby oznaczonej danym identyfikatorem SHORTCODE mogą być przekazane przez uczestnika usługi ARM do KDPW komunikatem auth.clt.

Dane transakcyjne, które są wymagane RTS 22, a których KDPW nie otrzyma w plikach transakcyjnych z rynku mogą zostać przekazane przez uczestnika ARM za pomocą komunikatu auth.enr.

W trakcie generowania raportów KDPW nada unikalny identyfikator TRN (pole 2 tabeli 2 do RTS 22). Aby uniknąć możliwości zdublowania identyfikatora z identyfikatorami nadawanymi przez FI dla transakcji spoza rynku, KDPW przekaże zasady tworzenia TRN.

Raporty powstałe w ramach trybu uproszczonego będą składane do Nadzorca i równolegle przekazywane jako kopia raportu, notyfikacja do FI (auth.016).

7.2. Raporty transakcji z rynku regulowanego

7.2.1. Źródła pozyskiwania danych do raportowania z rynku regulowanego

Poniższa tabela zawiera ustalenia z GPW i BondSpot w zakresie źródeł pozyskiwania danych z rynku regulowanego GPW i BondSpot oraz Treasury BondSpot. Źródłami tymi są:

- Dane tworzone przez KDPW na podstawie baz referencyjnych innych niż baza danych podmiotów, danych osobowych oraz na podstawie reguł domyślnych;
- Dane z bazy referencyjnej Klientów zasilanej z pliku danych osobowych przekazywanych bezpośrednio przez FI do KDPW;
- Dane w plikach posesyjnych z rynku, odbieranych przez KDPW bezpośrednio z rynku;
- Dane z komunikatu uzupełniającego przekazywanego przez FI do KDPW – auth.enr. Komunikat można przestać do KDPW w dniu zawarcia transakcji na rynku;
- Zakłada się, że GPW i BondSpot prześle dane transakcyjne do KDPW w dniu T+1, po uprzednim wykonaniu rekoncyliacji danych SHORTCODE – long code wykonanej z Uczestnikami GPW i BondSpot w przypadku wykrycia niezgodności w zleceniach/bazie klientów;
- Uprawnienie KDPW do budowania raportów na bazie danych transakcyjnych otrzymanych z rynku wynika z deklaracji złożonej przez FI;
- KDPW przeprowadzi techniczny proces wyznaczania stron transakcji (kupujący/sprzedający) na podstawie danych posttransakcyjnych otrzymanych z rynku.
 - w przypadku transakcji zwykłych z rynku regulowanego podstawowego (oraz z rynku ASO) GPW i BondSpot, w raportach do Nadzorca między strony transakcji zostanie wprowadzony kod LEI KDPW_CCP jako centralnego kontrpartniera rozliczającego dany rynek,
 - w przypadku transakcji pakietowych w raportach do Nadzorca między strony transakcji zostanie wprowadzony kod MIC segmentu, na którym zawarto transakcję,
 - w przypadku transakcji, w których w plikach posttransakcyjnych z rynku wskazany zostanie Waiver występujący w polu 61 RTS 22, w raportach do Nadzorca znajdą się oryginalne strony transakcji.
 - w przypadku transakcji z Treasury BondSpot w raportach do Nadzorca znajdą się oryginalne strony transakcji.
- Kod Instytucji w ramach mechanizmu uproszczonego jest tym samym 4-znakowym kodem instytucji jakim oznaczani są uczestnicy rynku. Kopia raportu, notyfikacja (auth.016) jest przekazywana trybem bezpośrednim;
- W przypadku, gdy uczestnik usługi ARM złoży deklarację korzystania z mechanizmu budowania raportów z rynku regulowanego przez KDPW, w sytuacji gdy nie uda się zbudować raportu w wyznaczonym terminie (np. brak danych Klienta), KDPW prześle trybem bezpośrednim komunikat auth.str do uczestnika usługi ARM wraz z podaniem przyczyny braku budowy raportu. W takich przypadkach FI powinna zaraportować wskazaną transakcję w trybie bezpośrednim.

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr *
1	Report status	X			

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr *
2	Transaction Reference Number			X	
3	Trading venue transaction identification code				
4	Executing entity identification code			X	
5	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU	X			
6	Submitting entity identification code	X			
7	Buyer identification code			X	
8	Country of the branch for the buyer		X		
9	Buyer - first name(s)		X		
10	Buyer - surname(s)		X		
11	Buyer - date of birth		X		
12	Buyer decision maker code				X
13	Buy decision maker - First Name(s)		X		
14	Buy decision maker – Surname(s)		X		
15	Buy decision maker - Date of birth		X		
16	Seller identification code			X	
17	Country of the branch for the seller		X		
18	Seller - first name(s)		X		
19	Seller - surname(s)		X		

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr *
20	Seller - date of birth		X		
21	Seller decision maker code				X
22	Sell decision maker - First Name(s)		X		
23	Sell decision maker – Surname(s)		X		
24	Sell decision maker - Date of birth		X		
25	Transmission of order indicator	X			
26	Transmitting firm identification code for the buyer			X	
27	Transmitting firm identification code for the seller			X	
28	Trading date time			X	
29	Trading capacity			X	
30	Quantity			X	
31	Quantity currency			X	
32	Derivative notional increase/decrease	X			
33	Price			X	
34	Price Currency			X	
35	Net amount	X			
36	Venue			X	
37	Country of the branch membership		X		
38	Up-front payment	X			

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr *
39	Up-front payment currency	X			
40	Complex trade component id				X
41	Instrument identification code			X	
42	Instrument full name	X			
43	Instrument classification	X			
44	Notional currency 1	X			
45	Notional currency 2	X			
46	Price multiplier	X			
47	Underlying instrument code	X			
48	Underlying index name	X			
49	Term of the underlying index	X			
50	Option type	X			
51	Strike price	X			
52	Strike price currency	X			
53	Option exercise style	X			
54	Maturity date	X			
55	Expiry date	X			
56	Delivery type	X			
57	Investment decision within firm			X	
58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision		X		
59	Execution within firm			X	

Tabela 7a: Źródła danych do raportów z rynku regulowanego					
	FIELD	Dane tworzone przez KDPW	Dane z bazy danych osobowych tworzonej na podstawie komunikatu auth.clt	Dane w plikach posesyjnych z rynku	Dane przekazane w komunikacie auth.enr *
60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution		X		
61	Waiver indicator			X	
62	Short selling indicator				X
63	OTC post-trade indicator	X			
64	Commodity derivative indicator	X			
65	Securities financing transaction indicator	X			

* W raportowaniu transakcji z rynku Treasury BondSpot komunikat auth.enr.001.01 nie jest stosowany (komplet danych pochodzi z rynku lub jest wyznaczany przez ARM).

7.2.2. Zasady wypełniania pól w raporcie do Nadzorczy, dla których wartość tworzona jest w KDPW

Zasady wypełniania danych na podstawie baz referencyjnych innych niż baza Klientów oraz reguł domyślnych:

- Pole 1 'NEWT' – New ; 'CANC' – Cancellation.
- Pole 5: Zakłada się, że wszyscy uczestnicy (działający na rynku regulowanym) są FI, zatem wartość zawsze równa 'true'.
- Pole 6. Stała wartość: LEI KDPW: 259400L3KBYEVNHEJF55 .
- Pole 25:
 - „true” – gdy w plikach transakcyjnych z rynku KDPW otrzyma informację o identyfikatorze firmy inwestycyjnej transmitującej zlecenie kupującego lub sprzedającego,
 - „false” – gdy w plikach transakcyjnych z rynku KDPW nie otrzyma informacji o identyfikatorze firmy inwestycyjnej transmitującej zlecenie kupującego lub sprzedającego.
- Pole 32. Nie dotyczy transakcji z rynku regulowanego, w związku z czym w raporcie do Nadzorczy tag będzie pominięty.
- Pole 35:
 - pole dotyczy instrumentów dłużnych
 - dla instrumentów dłużnych wartość ta będzie iloczynem wartości z pola nr 30 - Quantity – i wartości rynkowej instrumentu wyznaczonej przez KDPW.
- Pola 38 – 39. Nie dotyczy transakcji z rynku, w związku z czym w raporcie do Nadzorczy sekcja/tagi będą pomijane.

- Pola 42 – 56. Nie dotyczy transakcji, dla których znany jest ISIN instrumentu, w związku z czym w raporcie do Nadzorca sekcja/tagi będą pomijane. W trybie uproszczonym pola nigdy nie będą wypełniane.
- Pola 42 – 56. Nie dotyczy transakcji z rynku, w związku z czym w raporcie do Nadzorca sekcja/tagi będą pomijane. W trybie uproszczonym pola zawsze pomijane.
- Pole 63. Pole będzie pomijane w raporcie. Transakcje z rynku nie są transakcjami OTC.
- Pole 64. Pole będzie pomijane w raporcie – dotyczy wyłącznie derywatów towarowych.
- Pole 65. Zawsze 'false'. Dotyczy transakcji podlegających pod SFTR.

7.2.3. Przetwarzanie danych z komunikatu uzupełniającego dot. transakcji otrzymanych od FI

Zakłada się, że jeśli komunikat uzupełniający nie dotrze do określonej godziny, która została wskazana w regulaminie usługi lub określony tag/sekcja nie zostaną w nim wypełnione, to wszystkie lub część pól raportu składanego do Nadzorca będzie wypełniana domyślnie przez KDPW.

Dane uzupełniające będą przekazywane dedykowanym komunikatem auth.enr. Procesowanie poszczególnych pól będzie wykonywane w następujący sposób:

- Pole 12-15. Jeśli w określonym czasie KDPW nie otrzyma komunikatu od FI lub dedykowany tag zostanie pominięty w otrzymanym komunikacie uzupełniającym, wówczas pole zostanie pominięte w raporcie. W przypadku otrzymania danej od FI w komunikacie uzupełniającym (przesłanym w umówionym czasie) wartość w polu zostanie uzupełniona na podstawie wskazanego w komunikacie wzbogacającym przez FI SHORTCODE lub wskazanych pełnych danych.
- Pole 21-24. Jeśli w określonym czasie KDPW nie otrzyma komunikatu od FI lub dedykowany tag zostanie pominięty w otrzymanym komunikacie uzupełniającym, wówczas pole zostanie pominięte w raporcie. W przypadku otrzymania danej od FI w komunikacie uzupełniającym (przesłanym w umówionym czasie) wartość w polu zostanie uzupełniona na podstawie wskazanego SHORTCODE w komunikacie wzbogacającym lub wskazanych pełnych danych.

W przypadku pól podejmującego decyzję za sprzedającego i kupującego istnieje reguła domyślnego wypełniania identyfikatorów przez KDPW_ARM zgodnie z poniższymi zasadami.

- W przypadku, gdy w danych transakcyjnych otrzymanych przez ARM z rynku dana FI będzie zawierać transakcję własną – Trading capacity 'DEAL', czyli FI będzie kupującym lub sprzedającym, a drugim kontrahentem będzie KDPW_CCP rozliczające dany rynek i jednocześnie w danych transakcyjnych z rynku zostanie wskazany podejmujący decyzję wewnątrz firmy, wówczas pole podejmujący decyzję w imieniu kupującego lub sprzedającego nie będzie możliwe do uzupełnienia komunikatem wzbogacającym. Co do zasady pole to nie będzie uzupełniane w raporcie do Nadzorca.
 - W przypadku, gdy w danych transakcyjnych z rynku transakcja będzie zawierana w imieniu klienta danej FI - Trading capacity 'AOTC' i klient będzie kupującym lub sprzedającym, a drugim kontrahentem będzie KDPW_CCP rozliczające dany rynek i jednocześnie w danych transakcyjnych z rynku zostanie wskazany podejmujący decyzję wewnątrz firmy, wówczas pole podejmujący decyzję w imieniu kupującego/sprzedającego nie będzie możliwe do uzupełnienia komunikatem wzbogacającym. Co do zasady pole to zostanie wypełnione LEI firmy inwestycyjnej.
- Pole 62.
 - Zgodnie z wartością przekazaną w dedykowanym tag-u w komunikacie uzupełniającym od FI – gdy w określonym czasie KDPW otrzyma komunikat od FI;

- 'UNDI' – gdy w określonym czasie KDPW otrzyma komunikat uzupełniający od FI, w którym jest wartość „UNDI” lub w określonym czasie nie zostanie przesłana żadna informacja, tj. nie otrzyma komunikatu lub otrzyma komunikat, w którym dedykowany tag zostanie pominięty.

8. Raportowanie w trybie bezpośrednim

Uczestnicy usługi ARM mogą przekazywać raporty do KDPW w formie komunikatów XML do godziny wskazanej w regulaminie usługi, w dniu T+1, gdzie T- data zawarcia transakcji. KDPW wykona kontrole formalne (m.in. zgodność ze schemą XSD) oraz merytoryczne (zgodnie z opisem w rozdziale Kontrole merytoryczne raportów o transakcjach rejestrowanych w bazach usługi ARM). Komunikat zwrotny informujący o poprawności komunikatu lub o błędzie, zostanie przekazany zwrotnie uczestnikowi. Uczestnik usługi ARM otrzyma również komunikat lub komunikaty notyfikacyjne odebrane od Nadzorca. W trakcie raportowania w trybie Bezpośrednim KDPW będzie sprawdzać unikalność TRN.

9. Raportowanie delegowane

Usługa ARM oferowana przez KDPW zakłada możliwość składania raportów przez firmy pośredniczące w imieniu FI, tzw. Reprezentanta. W przypadku, gdy reprezentant będzie chciał skorzystać z opcji zasilania bazy klientów danymi, a następnie przekazywania w transakcjach identyfikatorów SHORTCODE będzie zobowiązany do zapewnienia unikalności identyfikatorów SHORTCODE w ramach wszystkich swoich klientów, za których składa raporty.

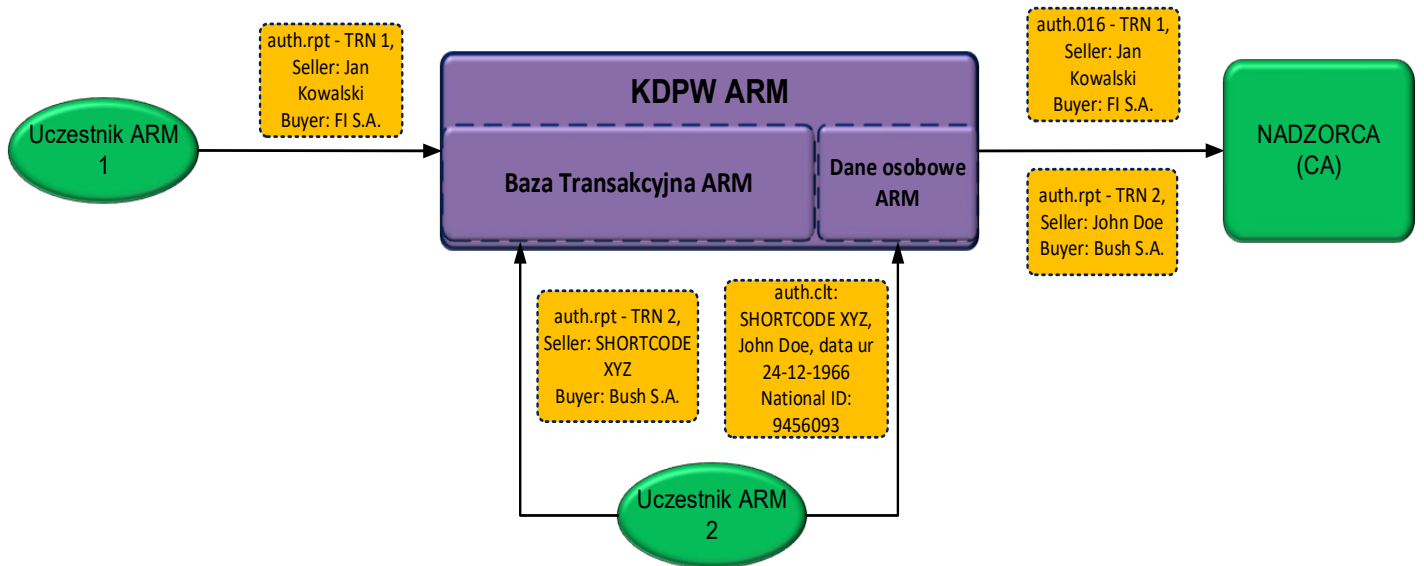
10. Wymagane dane osobowe

Regulacje prawne opisujące zasady raportowania w wielu miejscach zobowiązują podmiot dostarczający informacje do organów nadzoru do przekazania szeregu danych osobowych. Biorąc pod uwagę bezpieczeństwo tych danych jak również ogólnoeuropejskie ustalenia rynkowe najbardziej uniwersalnym modelem będzie stosowanie SHORTCODE-ów. W tym celu został powołany komunikat auth.clt. Nie oznacza to jednak pozbawienia uczestników usługi ARM możliwości przekazywania wymaganych danych również bezpośrednio w raportach.

Unikalność kodu SHORTCODE jest zapewniona na poziomie każdego uczestnika raportującego. Uczestnik usługi ARM, składający raport zgodnie z MIFIR, może złożyć go z wypełnieniem pełnych danych osobowych klientów w przesyłanym komunikacie lub wypełniając właściwe pola identyfikatorami SHORTCODE, a dane osobowe kryjące się pod danym identyfikatorem uzupełnić za pomocą komunikatu auth.clt przekazywanego bezpośrednio do KDPW. Wówczas dane te zostaną uzupełnione przez KDPW w momencie budowania raportu do Nadzorca, przy użyciu bazy danych osobowych. W ten sposób uczestnik może przekazać dane osobowe tylko raz, a potem w razie potrzeby dokonać ich aktualizacji, zaś ARM użyje ich wielokrotnie w każdym przekazanym do Nadzorca komunikacie.

Poniższy schemat przedstawia sposoby przekazywania i uzupełniania komunikatów o dane osobowe klientów.

Przekazywanie danych osobowych Uczestnik - ARM - Nadzorca



11. Raportowanie przez ARM do Nadzorców

Regulacje wymagają, aby raporty przekazywane do Nadzorczy przez podmiot będący ARM miały określoną strukturę komunikatów XML i były przekazywane w terminie T+1, gdzie T – data zawarcia transakcji. Zakłada się przekazywanie raportów w cyklach dziennych, w trybie 1:1 tzn. 1 raport otrzymany = 1 raport przekazany. Nie wyklucza się jednak obsługi komunikatów, w których przekazywane będą jednocześnie zbiory transakcji, tzn. 1 komunikat = 1+ n transakcji.

Identyfikacja Nadzorczy, do którego zostanie przekazany raport, bazuje na kodzie LEI podanym w polu 4 tabeli 2 do RTS 22: Executing entity identification code oraz kraju siedziby podmiotu podanej w bazie GLEIF.

Lista komunikatów związanych z przekazywaniem raportów do Nadzorczy obejmuje:

- raport - auth.016.001.01,
- status raportu - auth.031.001.01,
- nagłówek BAH - head.001.001.01,
- nagłówek pliku - head.003.001.01.

Dla odebranych poprawnych raportów, KDPW przekazuje zwrotnie do uczestnika usługi ARM status auth.str oraz notyfikację w postaci kopii przekazanego raportu - auth.016 w tym samym momencie, w którym raport przekazywany jest do Nadzorczy.

Do FI komunikatem auth.str przekazywany jest niezwłocznie każdy (także powtórny) komunikat statusowy otrzymywany od Nadzorczy. Według obecnie opublikowanych informacji Nadzorca ma czas T+7 na procesowanie i wysyłanie statusów do otrzymanych komunikatów.

W poniższej tabeli przedstawiono listę stosowanych kodów statusu generowanych przez Nadzorców dotyczących walidacji pojedynczego raportu/transakcji.

Tabela 12b: Listę stosowanych przez nadzorcę kodów statusu i kodów błędu dotyczących walidacji pojedynczego raportu/transakcji			
Kod statusu	Nazwa	Definicja	Zastosowanie w raportach podmiotów zgłaszających
ACPT	Przyjęto	Transakcja została przyjęta.	W trakcie pierwszej walidacji pliku kod statusu ACPT podaje się wyłącznie w statystyce komunikatu pliku ze statusem. Status można wskazać bezpośrednio w przypadku transakcji, która wcześniej miała status PDNG.
ACPD	Przyjęto po oczekiwaniu	Transakcja oczekująca, w poprzednim raporcie została przyjęta.	Nie stosowany.
PDNG	Oczekuje	Transakcja oczekuje na przetworzenie.	Kod statusu stosowany w przypadku, gdy raport o transakcji nie może być zwalidowany z powodu braku danych referencyjnych instrumentu. W złożonym elemencie RcrdSts należy podać kod błędu CON-411 (oczekiwanie na walidację instrumentu), CON-471 (oczekiwanie na walidację instrumentu bazowego). W przypadku zastosowania tego statusu, transakcja powinna zostać zgłoszona jako odrzucona lub przyjęta w jednym z kolejnych komunikatów zwrotnych wysłanych maksymalnie w ciągu 7 dni.
WARN	Ostrzeżenie	Transakcję przyjęto z ostrzeżeniem.	Nie stosowany.
RJCT	Odrzucono	Transakcję odrzucono.	Kod statusu stosowany w przypadku błędnego raportu o transakcji. Kody błędu wskazujące naruszone zasady walidacji należy wskazać w elemencie złożonym RcrdSts (kody CON-NNN z wyjątkiem CON-411 i CON-471).
RJPD	Odrzucono po oczekiwaniu	Transakcja oczekująca, w poprzednim raporcie została odrzucona.	Nie stosowany.

Więcej szczegółów na temat raportowania do Nadzorcy i przekazywania danych pomiędzy Nadzorcami znajduje się w dokumencie Technical Reporting Instructions - MiFIR Transaction Reporting.

W komunikatach statusowych wysyłanych do Uczestników za pośrednictwem auth.str.001.01 wysyłane są wyłącznie statusy do rekordu/transakcji przewidziane w słownikach ESMA (zgodnie z powyższą tabelą) oraz statusy własne ARM do rekordów/transakcji (wykaz statusów zawiera poniższa tabela). Tym samym w komunikacji z uczestnikami ARM nie będzie stosował statusów rekordu.

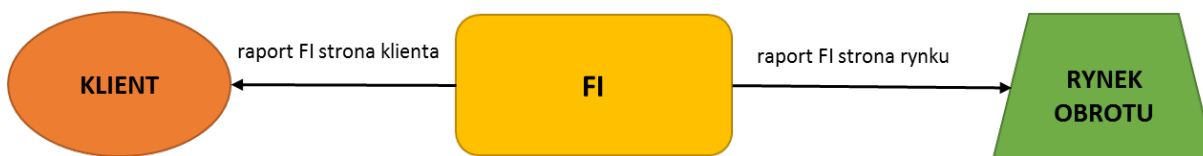
Tab.13 .Lista stosowanych przez ARM kodów statusu dotyczących walidacji pojedynczego raportu/transakcji

Kod statusu	Nazwa	Definicja	Dodatkowa informacja
ARAC	Przyjęto	Zaakceptowana/przyjęta przez ARM. Accepted by ARM.	
ARPD	Oczekuje	Transakcja oczekuje na przetwarzanie. Processing is pending at ARM level.	Status stosowany w trakcie obsługi usunięcia transakcji.
ARCC	Przyjęto usunięcie	Przyjęto żądanie usunięcia transakcji w ARM	Status stosowany w trakcie obsługi żądań usunięcia transakcji, gdy transakcja nie została jeszcze zaraportowana do Nadzorczy
ARWR	Zaakceptowana z ostrzeżeniem	Transakcję przyjęto z ostrzeżeniem. Accepted by ARM with warnings.	Status informujący o: - braku występowania danego instrumentu na liście FIRDS, - braku usuwanej transakcji w bazach KDPW_ARM
ARRJ	Odrzucono	Transakcję odrzucono. Rejected by ARM.	
ARCL	Usunięto	Transakcję usunięto z ARM. Removed from ARM.	Status wysyłany gdy transakcja zmienia status na usunięta z baz ARM.
ARRW	Ostrzeżenie o naprawie	Ostrzeżenie, transakcja niepoprawna z możliwością naprawy. ARM warning, report for repair.	Status wysyłany w przypadku gdy w trybie uproszczonym w momencie odebrania transakcji z rynku w ARM nie ma danych osobowych.

Proste przykłady raportowania

11.1. Raportowanie transakcji z rynków zorganizowanych

Przykład 1. Transakcja na rachunek własny (zlecenie klienta)



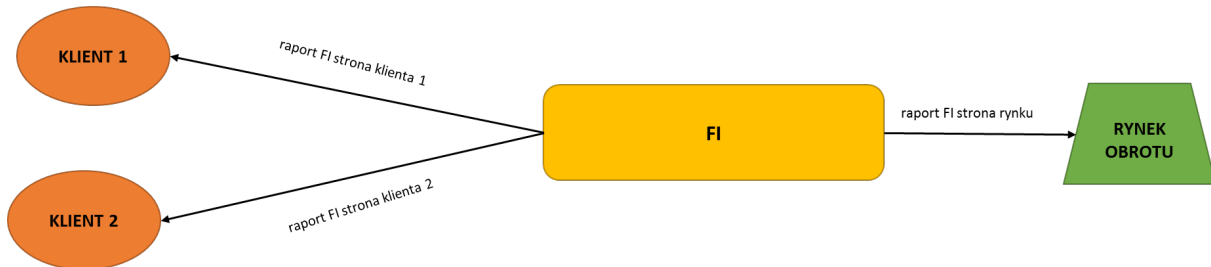
FI (FI SA) otrzymuje zlecenie od klienta (Firmy Notes SA) na zakup instrumentów na Rynku obrotu R. FI SA realizuje zlecenie na rachunek własny (po cenie 0.352 GBP i odsprzedaje instrument Firmie Notes SA po cenie 0.370 GBP).

FI SA zobowiązana jest do przesłania 2 następujących raportów do Nadzorca (zgodnie z powyższym schematem).

Tabela 13a: Przykład 1

Nr pola (tabela 2 RTS 22)	Pole	Wartość w raporcie 1 (strona rynku)	Wartość w raporcie 2 (strona klienta)
4	Executing entity identification code	{LEI} Firmy FI SA	{LEI} Firmy FI SA
7	Buyer identification code	{LEI} Firmy FI SA	{LEI} Firmy Notes SA
16	Seller identification code	{LEI} CCP obsługującego Rynek R	{LEI} Firmy FI SA
29	Trading capacity	'DEAL'	'DEAL'
33	Price	'0.352'	'0.370'
36	Venue	MIC segmentu Rynku R	'XOFF'

Przykład 2. Transakcja realizująca kilka zleceń klientów



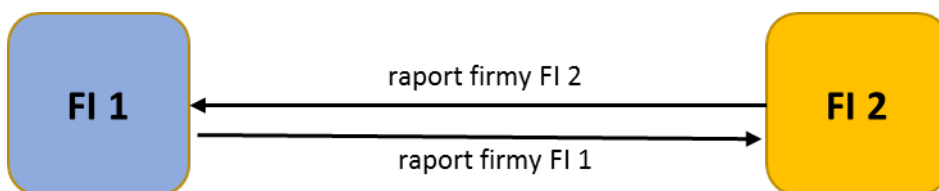
Firma FI otrzymuje zlecenia od Klienta 1 i Klienta 2 na zakup tego samego instrumentu (wolumen 100 dla Klienta 1 i 200 dla Klienta 2) na Rynku R. Firma agreguje zlecenia i zawiera transakcje na rynku R (w dniu 1 lipca 2018 o godzinie 10:00) – wolumen 300 po cenie 25,54 EUR. Zakupione instrumenty są lokowane na konta klientów 15 minut później. Firma działa na rachunek własny.

Firma FI zobowiązana jest przesłać 3 raporty, zgodnie z powyższym schematem.

Nr pola (tabela 2 RTS 22)	Pole	Wartość w raporcie FI – strona Rynku	Wartość w raporcie FI – strona Klienta 1	Wartość w raporcie FI – strona Klienta 2
4	Executing entity identification code	{LEI} firmy FI	{LEI} firmy FI	{LEI} firmy FI

7	Buyer identification code	{{LEI} firmy FI	{{LEI} Klienta 1	{LEI} Klienta 2
16	Seller identification code	{LEI} CCP for obsługującego Rynek R	{LEI} firmy FI	{LEI} firmy FI
28	Trading date time	'2018-07-01T10:00:00Z'	'2018-07-01T10:15:00Z'	'2018-07-01T10:15:00Z'
29	Trading capacity	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Quantity	'300'	'100'	'200'
33	Price	'25.54'	'25.54'	'25.54'
36	Venue	{MIC} segment Rynku R	'XOFF'	'XOFF'

11.2. Raportowanie transakcji z rynku OTC



Firma FI 1 zawiera transakcję na akcjach z firmą FI 2 poza rynkiem obrotu. Obie firmy działają na rachunek własny. Transakcję kwalifikuje się jako 'duża w skali'. Jako transakcja OTC wymaga raportowania wartości w polu 63 - OTC post-trade indicator.

Obie firmy inwestycyjne zobowiązane są do przekazania raportów zgodnie z powyższym schematem.

Tabela 13c: Przykład 3			
Nr pola (tabela 2 RTS 22)	Field	Wartość w raporcie FI1	Wartość w raporcie FI2
4	Executing entity identification code	{LEI} firmy FI1	{LEI} firmy FI2
29	Trading capacity	'DEAL'	'DEAL'
36	Venue	'XOFF'	'XOFF'
63	OTC post-trade indicator	'LRGS'	'LRGS'

12. Opłaty

Opłaty określa dedykowany rozdział Regulaminu ARM.