

***Materiał informacyjny – schematy przepływów statusów w systemie
KDPW_ARM***

Spis treści

Historia zmian.....	3
Słownik pojęć.....	3
I. Wykaz statusów w usłudze KDPW ARM.....	3
II. Cykl życia zaraportowanej transakcji	4
III. Obsługa usuwania transakcji (cancel).....	6
IV. Uzupelnienie danych o transakcjach (enrichment).....	7
V. Cykl życia danych osobowych (klienta)	9

Historia zmian

DATA AKTUALIZACJI	WERSJA	OPIS
28.09.2017	1.0	Powstanie dokumentu

Słownik pojęć

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 następujących polach: osoba podejmująca decyzję w imieniu kupującego/sprzedającego, decyzja inwestycyjna wewnątrz firmy, wykonanie wewnątrz firmy, FI transmitująca zlecenie.

Uczestnik - Podmiot będący stroną zawartej umowy z KDPW (dot. usługi KDPW_ARM).

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

KDPW_TR – usługa repozytorium transakcji oferowana przez KDPW.

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

I. Wykaz statusów w usłudze KDPW ARM

W usłudze KDPW_ARM w komunikatach statusowych wykorzystywane będą następujące kody statusów do rekordów/transakcji.

Statusy własne KDPW_ARM:

- ARPD – Pending at ARM.

- ARWR – Warning at ARM.
- ARAC – Accepted by ARM.
- ARRW – ARM warning, report for repair.
- ARRJ – Rejected by ARM.
- ARCL – Removed from ARM.
- ARCC – Cancellation request completed by ARM.

Statusy Nadzorcy – określone przez ESMA:

- PNDG – Pending.
- ACPT – Accepted.
- RJCT – Rejected.
- ACPD - Accepted After Pending. Status nie stosowany.
- WARN – Warning. Status nie stosowany.
- RJPD - Rejected After Pending. Status nie stosowany.

II. Cykl życia zaraportowanej transakcji

Raport z danymi transakcyjnymi jest przesyłany przez:

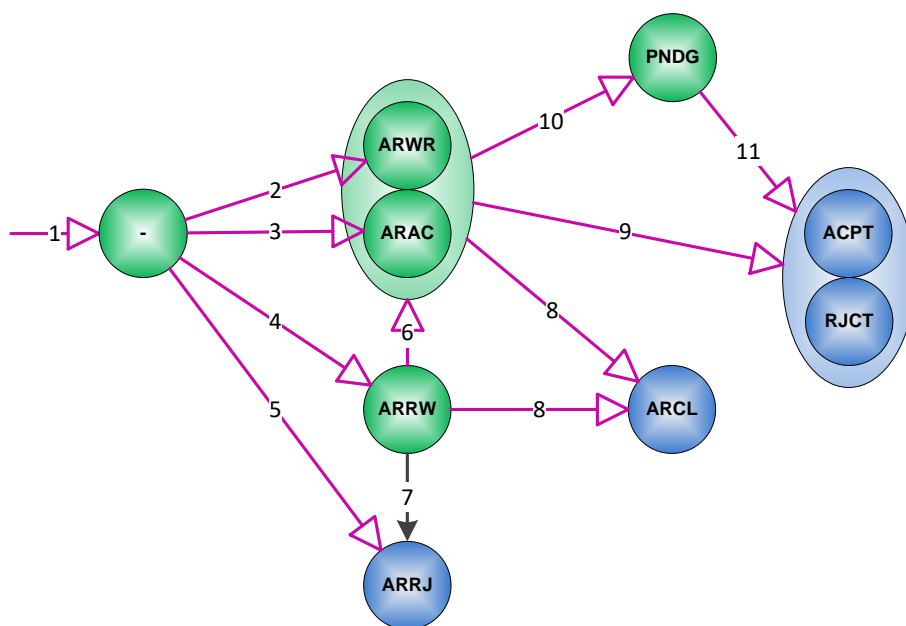
- Uczestnika KDPW_ARM w trybie bezpośrednim komunikatem auth.rpt.
- Rynek – GPW/BondSpot w tzw. trybie uproszczonym (z rynku).
- Uczestnika KDPW_TR i KDPW_ARM w tzw. trybie RT komunikatem trar.ins.

Do uczestnika zwrótnie zostanie przesłany wynik przeprowadzonych walidacji komunikatem auth.str.

Statusy wysyłane do Uczestników z związku z walidacją raportów z danymi transakcyjnymi:

- Statusy przejściowe
 - ARWR – Warning at ARM.
 - ARAC – Accepted by ARM.
 - ARRW – ARM warning, report for repair.
 - PNDG – Pending, status Nadzorcy.

- Statusy ostateczne:
 - ARRJ – Rejected by ARM.
 - ARCL – Removed from ARM.
 - ACPT – Accepted, status Nadzorcy.
 - RJCT – Rejected, status Nadzorcy.



Rysunek 1 – Schemat przejść pomiędzy statusami zaraportowanej transakcji

Procesy przejścia pomiędzy statusami do zgłoszenia raportu o transakcji:

1. Przyjęcie nowej transakcji do ARM.
2. Przejście przez kontrolę merytoryczną ARM ze zgłoszonym ostrzeżeniem.
3. Przejście przez kontrolę merytoryczną ARM bez błędów.
4. Błąd na kontroli merytorycznej ARM, możliwość poprawienia.
5. Błąd na kontroli merytorycznej ARM, brak możliwości poprawienia.
6. Powtórna kontrola merytoryczna (np. dostanie przez uczestnika danych osobowych).
7. Przekroczony czas na możliwości poprawy transakcji, transakcja odrzucona.
8. Transakcja usunięta przez uczestnika przed przekazaniem do Nadzorcy.
9. Transakcja zaraportowana do Nadzorcy, odebrano status akceptacji lub odrzucenia przez Nadzorcę.
10. Transakcja zaraportowana do Nadzorcy, odebrano status Pending od Nadzorcy.
11. Odebrano status akceptacji lub odrzucenia przez Nadzorcę.

III. Obsługa usuwania transakcji (cancel)

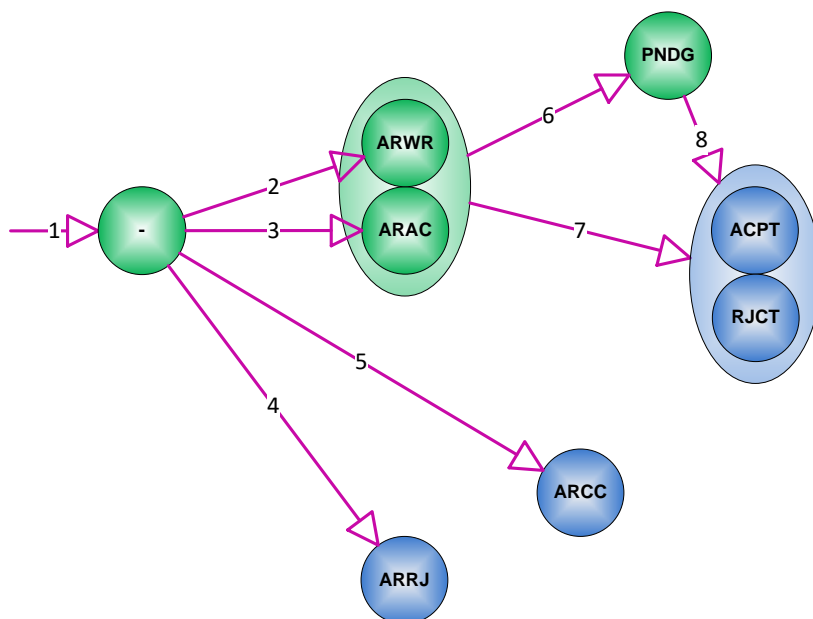
Żądanie usunięcia może zostać przesłane przez Uczestnika KDPW_ARM komunikatem auth.rpt. lub przez Uczestnika KDPW_TR i KDPW_ARM komunikatem trar.ins.

Każde nowe żądanie usunięcia podlega kontroli merytorycznej. Obecnie brak jest zdefiniowanych kontroli, więc każde żądanie usunięcia przechodzi ją poprawnie. W szczególności zakłada się, że można usuwać transakcje, które nie zostały wcześniej przesłane do ARM (wymóg zdefiniowany przez ESMA w Guidelines), dlatego też nie jest sprawdzana unikalność TxId w trakcie przetwarzania usunięć.

Do uczestnika zwrotnie zostanie przesłany komunikat lub komunikaty auth.str z wynikiem walidacji przesłanego przez Uczestnika komunikatu z żądaniem usunięcia.

Statusy wysyłane do Uczestników w związku z obsługą usunięć:

- Statusy przejściowe:
 - ARAC – Accepted by ARM.
 - ARWR – Warning at ARM.
 - PNDG – Pending, status Nadzorcy.
- Statusy ostateczne:
 - ARRJ – Rejected by ARM.
 - ARCC – Cancellation request completed by ARM.
 - ACPT – Accepted, status Nadzorcy.
 - RJCT – Rejected, status Nadzorcy.



Rysunek 2 – Schemat przejść pomiędzy statusami żądania usunięcia transakcji

Procesy przejścia pomiędzy statusami do żądania usunięcia transakcji:

1. Przyjęcie nowego żądania usunięcia.
2. Przejście przez kontrolę merytoryczną, nie znaleziono wskazanej transakcji.
3. Przejście przez kontrolę merytoryczną, znaleziono wskazaną transakcję, została ona już przekazana do Nadzorcy,
4. Błąd na kontroli merytorycznej ARM – obecnie proces nie obsługiwany,
5. Przejście przez kontrolę merytoryczną, znaleziono wskazaną transakcję, nie została ona jeszcze przekazana do Nadzorcy, usunięcie zrealizowane wewnętrznie,
6. Żądanie usunięcia zaraportowane do Nadzorcy, odebrano status PNDG,
7. Żądanie usunięcia zaraportowane do Nadzorcy, odebrano status akceptacji lub odrzucenia od Nadzorcy.
8. Odebrano status akceptacji lub odrzucenia przez Nadzorcę.

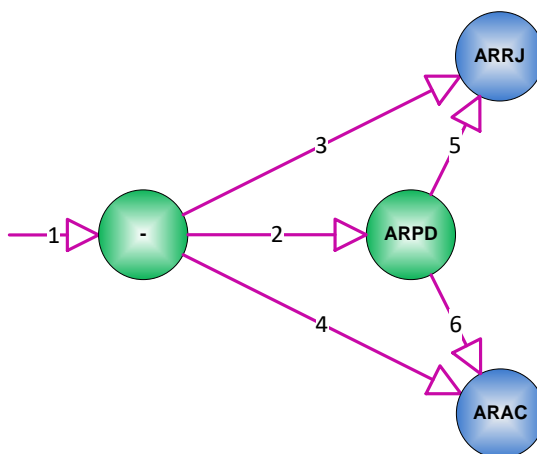
IV. Uzupelnienie danych o transakcjach (enrichment)

Uczestnik może, dla transakcji z rynku, raportowanych w trybie uproszczonym, przesłać komunikat auth.enr uzupełniający dane o transakcjach.

Do uczestnika zwrótnie zostanie wysłany komunikat statusowy auth.ste z wynikiem przyjęcia/odrzućenia przesłanego przez uczestnika komunikatu z danymi uzupełniającymi transakcję.

Statusy wysyłane do uczestników w związku z obsługą uzupełnień:

- Statusy przejściowe:
 - ARPD – Pending at ARM.
- Statusy ostateczne:
 - ARAC – Accepted by ARM.
 - ARRJ – Rejected by ARM.



Rysunek 3 – Schemat przejść pomiędzy statusami uzupełnienia transakcji

Procesy przejścia pomiędzy statusami uzupełnienia transakcji:

1. Przyjęcie nowego żądania uzupełnienia transakcji.
2. Poprawne przejście przez kontrolę merytoryczną, nie znaleziono wskazanej transakcji w bazach ARM, oczekuje na odebranie danych transakcyjnych z rynku i ostateczną walidację.
3. Odrzucenie uzupełnienia przez kontrolę merytoryczną.
4. Przejście przez kontrolę merytoryczną, znaleziono transakcję, zrealizowano żądanie uzupełnienia.
5. Minął czas na dostarczenie transakcji, żądanie uzupełnienia odrzucone.
6. Powtórna kontrola żądania uzupełnienia, znaleziono transakcję, zrealizowano żądanie uzupełnienia.

V. Cykl życia danych osobowych (klienta)

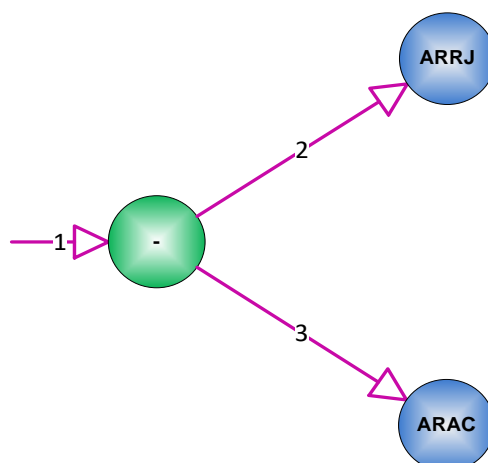
Uczestnik może, niezależnie od trybu raportowania, przesłać komunikat auth.clt z danymi osobowymi przypisanymi do danego SHORTCODE. W związku z powyższym Uczestnik ma możliwości:

- Zgłoszenia nowego SHORTCODE wraz z danymi referencyjnymi.
- Modyfikacji danych referencyjnych przypisanych do danego SHORTCODE.
- Usunięcie danego SHORTCODE wraz z danymi referencyjnymi.

Do Uczestnika zwrótnie zostanie wysłany komunikat statusowy auth.stc z wynikiem walidacji przesłanego przez Uczestnika komunikatu z danymi osobowymi.

Statusy wysyłane do Uczestników w związku ze zgłoszeniem danych osobowych:

- Statusy przejściowe:
 - ARPD – Pending at ARM, obecnie nie wysyłany do uczestników.
- Statusy ostateczne:
 - ARAC – Accepted by ARM.
 - ARRJ – Rejected by ARM.



Rysunek 4 – Schemat przejść pomiędzy statusami zgłoszenia danych osobowych

Procesy przejścia pomiędzy statusami zgłoszenia danych osobowych:

1. Przyjęcie nowego zbioru danych osobowych.
2. Odrzucenie przez kontrolę merytoryczną.
3. Poprawne przejście przez kontrolę merytoryczną.