

Podstawowe zasady dotyczące potwierdzania warunków transakcji na Platformie konfirmacji.

1. Uczestnicy rozliczający KDPW\_CCP przekazują do systemu kdpw\_stream instrukcje konfirmacyjne do zestawienia za pośrednictwem wskazanego kanału komunikacji (dopuszczalne: ESDI, ESDK, SWIFT).
2. W ramach przyjęcia instrukcji na Platformę wykonywane są następujące operacje:
  - a) kontrola formalna komunikatu w oparciu o schemat XSD;
  - b) kontrola merytoryczna instrukcji realizowana poprzez weryfikację przekazanych danych z referencyjnymi bazami danych właściwych Platformie w KDPW\_CCP;
  - c) zapisanie instrukcji i poinformowanie wystawcy oraz drugiej strony rozliczenia transakcji, o jej statusie i przyjętych warunkach;
  - d) obsługa procesu usuwania niezestawionych instrukcji przez wystawcę;
  - e) próba odnalezienia odpowiadającej instrukcji od drugiej strony rozliczenia transakcji o zgodnych warunkach transakcji oraz wygenerowania właściwej instrukcji rozliczeniowej.
  - f) odrzucenie instrukcji w przypadku, gdy nie została ona zestawiona do określonego terminu równego dacie rozrachunku transakcji otwierającej.
3. Instrukcja przekazana na platformę powinna zawierać następujący zakres informacji:

1.	kod wystawcy instrukcji,
2.	identyfikator instrukcji nadany przez wystawcę,
3.	typ instrukcji
4.	kod rynku /pole obowiązkowe/,
5.	tryb obrotu,
6.	kod operacji,
7.	rodzaj transakcji /pole obowiązkowe dla transakcji repo i buy/sell back/,
8.	kod ISIN instrumentu finansowego /pole obowiązkowe/,
9.	liczba papierów wartościowych /pole obowiązkowe/,
10.	kod UZ /pole obowiązkowe/,
11.	kod UZ kontrpartnera /pole obowiązkowe/,
12.	kod UR /pole obowiązkowe/,
13.	konto rozliczeniowe u UR /pole obowiązkowe/
14.	typ konta rozliczeniowego /pole obowiązkowe/
15.	kod UR kontrpartnera/pole obowiązkowe/,
16.	konto rozliczeniowe u UR kontrpartnera /pole opcjonalne/
17.	data zawarcia transakcji /pole obowiązkowe/,
18.	data rozrachunku transakcji otwierającej /pole obowiązkowe/,
19.	data rozrachunku transakcji zamykającej /pole obowiązkowe/,
20.	wartość i kod waluty transakcji otwierającej /pole obowiązkowe/,
21.	wartość i kod waluty transakcji zamykającej /pole obowiązkowe/,
22.	wspólny identyfikator nadany przez każdą ze stron rozliczenia dla transakcji, której dotyczy instrukcja konfirmacyjna /pole nieobowiązkowe/,

4. Przekazana na platformę instrukcja powinna być oznaczona poprzez wskazanie następujących wartości dla określonych pól:

- a) kodu rynku - 'OC';
- b) trybu obrotu - 'ZG';
- c) kod operacji - 'RE';
- d) rodzaj transakcji:
  - a. 'R1' - transakcja repo,
  - b. 'R4' - transakcja buy-sell-back;
- e) Funkcja komunikatu:
  - o 'NEWM' - nowa instrukcja,
  - o 'CANC' - usunięcie przekazanej wcześniej instrukcji.

5. W celu usunięcia instrukcji niezbędne jest przekazanie na Platformę komunikatu ze wskazaniem funkcji instrukcji właściwej dla usunięcia 'CANC' z wypełnionym identyfikatorem poprzednio przekazanej instrukcji (wskazanie identyfikatora usuwanej, wcześniej przekazanej instrukcji). Warunkiem skutecznego usunięcia instrukcji jest przekazanie poprawnego identyfikatora usuwanej instrukcji (sekcja Lnk w komunikacie) oraz zgodność wystawcy instrukcji z kodem wystawcy żądania jej usunięcia – zgodność pozostałych pól nie jest sprawdzana. Dodatkowo wymagane jest, aby komunikat usuwający został przekazany do przetworzenia przez Platformę przed skutecznym zestawieniem się instrukcji confirmacyjnych. W przeciwnym przypadku, nawet przy przekazaniu żądania usunięcia przez obie strony transakcji, odwołanie instrukcji nie jest możliwe, z założenia bowiem instrukcje zestawione na platformie będą niezwłocznie podlegały dalszemu procesowi – utworzeniu instrukcji rozliczeniowej i przekazaniu jej do rozliczeń.

6. Przetworzenie żądania usunięcia niezestawionej instrukcji confirmacyjnej następuje niezwłocznie po jego otrzymaniu przez Platformę.

7. W ramach Platformy Confirmacji wyróżniamy następujące identyfikatory:

- a) identyfikator instrukcji confirmacyjnej nadany przez wystawcę,
- b) identyfikator instrukcji confirmacyjnej nadany przez Platformę,
- c) wspólny identyfikator,
- d) identyfikator wygenerowanej instrukcji rozliczeniowej nadany przez Platformę.

Wszystkie te identyfikatory są reprezentowane przez maksymalnie szesnastoznakowy, nieznaczący ciąg znaków.

#### Ad a) Identyfikator instrukcji confirmacyjnej nadany przez wystawcę

Każda instrukcja przekazana przez Uczestnika na Platformę powinna być przez niego oznaczona własnym identyfikatorem transakcji (pole *SndrMsgRef*). Zarówno Platforma Confirmacji jak i KDPW\_CCP nie weryfikują przekazanego identyfikatora pod kątem jego unikalności, co leży wyłącznie w gestii wystawcy. Identyfikator ten będzie przekazywany wystawcy w każdym komunikacie statusowym dotyczącym instrukcji. Służyć on również będzie wystawcy do usunięcia instrukcji confirmacyjnej z platformy.

Identyfikator ten zostanie także przekazany do KDPW\_CCP w wynikowej instrukcji rozliczeniowej, jako identyfikator zlecenia dla właściwej strony rozliczenia transakcji.

Ad b) Identyfikator instrukcji confirmacyjnej nadany przez Platformę

Każda instrukcja przekazana przez Uczestnika na Platformę zostaje oznaczona identyfikatorem wewnętrznym, unikalnym w ramach Platformy niezależnie od wystawcy. O tym identyfikatorze wystawcy zostaną poinformowani w komunikacie statusowym (pole *AcctSvcrRef*). Będzie on mógł być wykorzystany w zastępstwie własnego identyfikatora wystawcy przy wystawieniu żądania usunięcia instrukcji z Platformy.

Identyfikator ten zostanie także przekazany do KDPW\_CCP w wynikowej instrukcji rozliczeniowej, jako rynkowy identyfikator zlecenia dla właściwej strony rozliczenia transakcji.

Ad c) Wspólny identyfikator

Opcjonalnie, instrukcje confirmacyjne mogą zostać opatrzone wspólnym identyfikatorem (pole *CmonRef*), który, jeśli zostanie wskazany, stanowi kryterium zestawiania instrukcji. Identyfikator taki powinien być uzgodniony przez strony transakcji. Wykorzystanie tego identyfikatora pozwala na zestawienie się konkretnych instrukcji, co może mieć znaczenie w przypadku zawarcia i potwierdzania kilku podobnych transakcji.

Ad d) Identyfikator wygenerowanej instrukcji rozliczeniowej nadany przez Platformę

W wyniku zestawienia, a tym samym skutecznego potwierdzenia warunków transakcji, generowana jest właściwa instrukcja rozliczeniowa, której nadawany jest unikalny identyfikator. Identyfikator ten przekazywany jest do systemu rozliczeniowego KDPW\_CCP jako identyfikator z Platformy (pole *MktRef*). O identyfikatorze tym poinformowani zostaną także wystawcy w komunikacie statusowym po skutecznym zestawieniu instrukcji confirmacyjnych.

8. Obowiązują następujące zasady dodatkowe:

- a) Liczba papierów- w instrukcji w formacie XML można określić liczbę papierów wyrażoną w jednostkach (tak jest najczęściej) lub w wartości nominalnej papierów. W przypadku wskazania wartości nominalnej system konwertuje wtedy podaną wartość nominalną na postać liczby jednostek.
- b) Kody instytucji- w instrukcji w formacie XML można określić kod instytucji zarówno poprzez kod KDPW\_CCP jak i poprzez kod BIC. W przypadku wskazania instytucji z wykorzystaniem BIC, właściwy kod KDPW\_CCP wyznaczany jest na podstawie danych referencyjnych dostępnych na Platformie.

9. Instrukcja confirmacyjna po przyjęciu przez platformę confirmacji poddawana jest kontroli merytorycznej prowadzonej w odniesieniu do referencyjnej bazy danych. W wyniku kontroli instrukcja uzyskuje odpowiedni status i w przypadku, gdy jest poprawna podlega dalszemu przetwarzaniu – próbie zestawienia z odpowiednią instrukcją kontrpartniera. W przypadku stwierdzenia błędu instrukcja jest automatycznie odrzucona.

### Ogólne kontrole instrukcji confirmacyjnej

- a) Dane przekazane w instrukcji confirmacyjnej powinny być zgodne z referencyjnymi bazami danych KDPW\_CCP w zakresie następujących pól:
  - kody instytucji wskazane w instrukcji,
  - kod ISIN instrumentu finansowego,
  - typ instrukcji,
  - kod rynku,
  - tryb obrotu,
  - kod operacji,
  - rodzaj transakcji,
  - rodzaj konta rozliczeniowego.
- b) Kod wystawcy instrukcji confirmacyjnej musi odpowiadać kodowi UR odpowiedniej strony transakcji (zależnie od wskazanego typu instrukcji).
- c) Data rozrachunku nie powinna być wcześniejsza niż data bieżąca w KDPW\_CCP.

### Kontrole instrukcji confirmacyjnej związanej z transakcją repo lub buy/sell back

(weryfikacja z uwzględnieniem kodu rynku, trybu obrotu oraz rodzaju transakcji) wykonywane są poniższe kontrole:

- a) W instrukcji powinna zostać wskazana data zawarcia transakcji. Data ta powinna być wcześniejsza lub równa dacie rozrachunku transakcji otwierającej.
- b) Data rozrachunku transakcji zamykającej powinna być podana. Data ta powinna być późniejsza niż data rozrachunku transakcji otwierającej.
- c) Wartość rozrachunku transakcji otwierającej i zamykającej powinna być podana.
- d) Dla daty rozrachunku wskazanej, jako dzień bieżący data otrzymania instrukcji (jej faktycznego przyjęcia przez Platformę Confirmacji) powinna być wcześniejsza od ustalonej w parametrach Platformy godziny granicznej (obecnie, jako godzinę graniczną wskazuje się 15:30).

### Statusy instrukcji confirmacyjnej

Kod statusu	Kod przyczyny	Opis
NMAT	-	Instrukcja przyjęta, oczekująca na zestawienie
MACH	-	Instrukcja zestawiona, przekazana do rozliczenia
CAND	różne	Instrukcja odrzucona – błędna merytorycznie. Kod przyczyny wskazuje na kod błędu
CAND	CANI	Instrukcja odrzucona przez wystawcę
CAND	CANS	Instrukcja odrzucona przez KDPW_CCP
CAND	EXPI	Instrukcja odrzucona - przeterminowana

### Zasady zestawiania instrukcji na Platformie

Platforma zestawia instrukcje na podstawie zgodności wszystkich pól wymaganych w instrukcji confirmacyjnej (dot. pól obowiązkowych i opcjonalnych, które zostały uzupełnione

przez Uczestników). Warunkiem koniecznym podjęcia próby zestawiania jest poprawność instrukcji pod względem merytorycznym.

Kryterium zestawiania dla instrukcji confirmacyjnych repo stanowią następujące informacje:

- |  |                                  |
|--|----------------------------------|
| 1) kod rynku                                 | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 2) rodzaj transakcji                         | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 3) kod instrumentu                           | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 4) liczba papierów                           | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 5) kod UZ                                    | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 6) kod UR                                    | - zgodny jeśli podany            |
| 7) id konta rozliczeniowego u UR             | - zgodny jeśli podany            |
| 8) data zawarcia transakcji                  | - zgodny bez uwzględnienia czasu |
| 9) data rozrachunku transakcji otwierającej  | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 10) wartość i waluta transakcji otwierającej | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 11) data rozrachunku transakcji zamykającej  | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 12) wartość i waluta transakcji zamykającej  | - zgodny dla obu instrukcji      |
| 13) wspólny identyfikator                    | - zgodny jeśli podany            |

W procesie zestawiania instrukcji confirmacyjnych nie uwzględnia się tolerancji dla wartości rozrachunku transakcji.

W wyniku zestawienia generowana jest instrukcja rozliczeniowa kierowana do rozliczenia w KDPW\_CCP.

#### Warunki przeterminowania instrukcji confirmacyjnych

Na Platformie Confirmacji przeterminowane instrukcje, które nie podległy zestawieniu są automatycznie odrzucone w procesie zakończenia dnia. Proces ten jest powiązany z przebiegiem dnia rozliczeniowego KDPW\_CCP i obejmuje wszystkie instrukcje confirmacyjne. W przypadku transakcji repo i buy/sell back, które na „bieżący dzień” mogą być przekazywane do określonej godziny granicznej, oznacza to, że transakcje nie zestawione do wskazanej godziny zostaną odrzucone.

O fakcie odrzucenia wystawcy zostaną poinformowani odpowiednim komunikatem statusowym.