

1. Daily Variation:

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
PA Account	identyfikator konta PA
Current MTM	bieżąca wycena transakcji wyrażona w walucie transakcji
Currency	waluta transakcji
Report Date	data, za którą wygenerowane są dane w raporcie
Baseline MTM	wycena transakcji na poprzedni dzień roboczy wyrażona w walucie transakcji (dla nowej transakcji jest to 0)
Daily Variation	różnica między Current MTM a Baseline MTM wyrażona w walucie transakcji (VM dla danej transakcji).

Opis:

Raport zawiera wszystkie transakcje własne uczestnika rozliczającego oraz jego klientów będące na kontach na koniec danego dnia.

2. New Trades:

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
Deal ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji przed nowacją nadany przez KDPW_CCP
Trade ID (CM)	identyfikator transakcji wprowadzony przez Uczestnika na platformie confirmacyjnej
Source	platforma confirmacyjna
Product	typ transakcji
Trade date	data zawarcia transakcji przez Uczestników
Nominal	nominał transakcji
Currency	waluta transakcji
Effective date	data rozpoczęcia transakcji
Maturity date	data zapadalności
Original Counterparty	czterocyfrowy identyfikator oryginalnego kontrpartnera
PA account	identyfikator konta PA
Report Date	data, za którą wygenerowane są dane w raporcie
Fixed rate	stopa stała

Opis:

Raport zawiera wszystkie transakcje przyjęte do rozliczenia przez KDPW_CCP w danym dniu będące na kontach na koniec tego dnia. Oznacza to, że raport nie zawiera transakcji, które uległy kompensacji danego dnia. Transakcje takie są widoczne w podsumowaniu kompensacji (komunikat E.3).

3. Settled Trades:

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
Trade ID (CM)	identyfikator transakcji wprowadzony przez Uczestnika na platformie confirmacyjnej
Product	typ transakcji
Currency	waluta transakcji
Trade date	data zawarcia oryginalnej transakcji przez Uczestników
Report Date	data, za którą wygenerowane są dane w raporcie
PA Account	identyfikator konta PA

Opis:

Raport zawiera wszystkie transakcje własne uczestnika rozliczającego oraz jego klientów będące na kontach na koniec danego dnia, które wygasają danego dnia. Dla FRA datą wygasania jest data rozliczenia (effective date), dla transakcji swap jest to data zapadalności (maturity date).

4. Payments:

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
Product	typ transakcji
Nominal	nominał transakcji
Currency	waluta transakcji
Report Date	data, za którą wygenerowane są dane w raporcie
CF value	wartość przepływu (kuponu lub płatności typu initial fee/ upfront fee)
Leg def	rodzaj przepływu, dla kuponu stałego – wartość "FIXED", dla kuponu zmiennego – stopa referencyjna, dla płatności typu initial fee/upfront fee – wartość "FEE"
Payment Date	data płatności zgodnie z konwencją dla danej waluty
PA Account	identyfikator konta PA

Opis:

Raport prezentuje wszystkie płatności kuponowe oraz płatności typu initial fee/upfront fee (FEE) rozrachowywane kolejnego dnia roboczego zgodnie z konwencją dla danej waluty. Każda płatność prezentowana jest jako osobny rekord. Oznacza to, że dana transakcja może występować w raporcie kilkakrotnie w zależności od liczby płatności.

5. Coupons fixing:

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
product	typ transakcji
Report Date	data, za którą wygenerowane są dane w raporcie
Currency	waluta transakcji
Coupon Payment Date	data płatności kuponu
Coupon value	wartość kuponu
Leg Def	stopa referencyjna
Fixed Rate	ustalona zmienna stawka referencyjna
PA Account	identyfikator konta PA

Opis:

Raport prezentuje wszystkie zmienne płatności kuponowe, dla których w danym dniu została ustalona zmienna stawka referencyjna. Dla danej transakcji każdy zmienny kupon prezentowany jest jako osobny rekord.

6. Cash flows:

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
Product	typ transakcji
Trade date	data zawarcia oryginalnej transakcji przez Uczestników
Maturity date	data zapadalności transakcji
Nominal	nominał transakcji
Currency	waluta transakcji
Leg def	Rodzaj przepływu. Dla kuponu stałego – wartość "FIXED", dla kuponu zmiennego – stopa referencyjna, dla płatności typu initial fee/upfront fee – wartość "FEE"
Fixing date	data ustalenia zmiennej stawki referencyjnej
Rate	wartość stawki
PV	wartość bieżąca przepływu (zdyskontowany kupon lub płatność typu initial fee/upfront fee).
DF	czynnik dyskontowy dla danego przepływu
CF value	wartość kuponu lub płatności typu initial fee/upfront fee
Payment date	data płatności kuponu lub FEE
Fixed	Znacznik tak / nie zależny od tego czy „data fixingu stawki” już minęła lub nie
Report Date	data, za którą wygenerowane są dane w raporcie
PA Account	identyfikator konta PA

Raport dostępny na zapytanie UR w postaci komunikatu otcd.rqi.001.01.executeReportRequest.

Opis:

Raport prezentuje wszystkie przepływy pieniężne dla wszystkich transakcji na kontach danego Uczestnika. Liczba wystąpień danej transakcji wynika z liczby przepływów. Raport ten jest wywoływany za pomocą identyfikatora 00085.

7. All Trades:

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
Deal ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji przed nowacją nadany przez KDPW_CCP
Trade ID (CM)	identyfikator transakcji wprowadzony przez Uczestnika na platformie confirmacyjnej
Source	platforma confirmacyjna
Product	typ transakcji
Trade date	data zawarcia transakcji przez Uczestników
Nominal	nominał transakcji
Currency	waluta transakcji
Effective date	data rozpoczęcia transakcji
Maturity date	data zapadalności
Original Counterparty	czterocyfrowy identyfikator oryginalnego kontrpartnera
PA account	identyfikator konta PA
Report Date	data za którą wygenerowane są dane w raporcie
Fixed rate	stopa stała
Navation Date	data nowacji

Raport dostępny na zapytanie UR w postaci komunikatu otcd.rqi.001.01.executeReportRequest.

Opis:

Raport zawiera wszystkie transakcje przyjęte do rozliczenia przez KDPW_CCP i aktywne w systemie kdpw_otc. Raport ten jest wywoływany za pomocą identyfikatora 00086.

8. Repo Cashflows

Nazwa pola	Zawartość pola
Trade ID (KDPW_CCP)	identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP
Deal ID (CM)	identyfikator transakcji nadany przez platformę confirmacji
PA Account	identyfikator konta PA
Trade Type	R1 dla repo, R4 dla SBB
Currency	Waluta rozliczenia
ISIN	ISIN obligacji
Security Volume	Ilość obligacji
First Leg Date	Oczekiwana data rozrachunku pierwszej nogi
First Leg Settlement Date	Rzeczywista data rozrachunku pierwszej nogi
Adjustment First Leg	Korekta (wyrównanie do rynku dla danej nogi)
Settlement First Leg	Wartość z kontraktu
Second Leg Date	Oczekiwana data rozrachunku drugiej nogi
Second Leg Settlement Date	Rzeczywista data rozrachunku drugiej nogi
Adjustment Second Leg	Korekta (wyrównanie do rynku dla danej nogi)
Settlement Second Leg	Wartość z kontraktu
Initial Margin Requirement	Wymagany depozyt w momencie wygenerowania raportu na konto PB dla danego konta PA

Raport dostępny na zapytanie UR w postaci komunikatu otcd.rqi.001.01.executeReportRequest.

Opis:

Raport zawiera wszystkie transakcje repo wraz ze szczegółami rozrachunku obydwu nóg. Raport ten jest wywoływany za pomocą identyfikatora 00087.