

LEGENDA:

Pola bez koloru – pola nie zmieniane w porównaniu do poprzedniej wersji

Pola w kolorze szarym – nowa lokalizacja pól w porównaniu do poprzedniej wersji

DOKUMENTACJA ZMIAN W SYSTEMIE KDPW_OTC W ZAKRESIE RAPORTÓW POSTROZLICZENIOWYCH

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 zarejestrowane 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 zarejestrowane 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

Opis:

Raport zawiera wszystkie transakcje własne uczestnika rozliczającego oraz jego klientów zarejestrowane 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

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

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
Report Date	data, za którą wygenerowane są dane w raporcie
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

Raport ten w przeciwieństwie do pozostałych nie jest wysyłany automatycznie. Jest on 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.

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 ten w przeciwieństwie do pozostałych nie jest wysyłany automatycznie. Jest on dostępny na zapytanie UR w postaci komunikatu otcd.rqi.001.01.executeReportRequest.

Opis:

Raport zawiera wszystkie transakcje przyjęte do rozliczenia przez KDPW_CCP i są aktywne w systemie.