

RAPORTOWNIE DO REPOZYTORIUM TRANSKCJI
(WYMOGI ROZPORZĄDZENIA EMIR)

Historia zmian

Ver	Data zmiany	Podsumowanie zmian
1.0	2020-12-14	Publikacja dokumentu
1.1	2021-02-11	Zmiana algorytmu UTI dla pozycji ETD (5.1.2) i drobne korekty
1.2	2021-02-23	Uszczegółowienie w zakresie raportowania zabezpieczeń

Spis treści:

1.	KDPW_CCP - dane kontrahenta	2
2.	Wstęp	2
3.	Raporty – szczegółowy opis przekazywania danych do KDPW_TR	3
3.1	Transakcje i pozycje.....	3
3.2	Wycena	4
3.3	Zabezpieczenie	5
4.	Sposób wypełniania poszczególnych pól w raportach	6
4.1	Kontrakty terminowe na indeksy i na akcje	6
4.2	Opcje na indeks WIG20	7
4.3	Kontrakty terminowe na kursy waluty	9
4.4	Interest Rate Swaps (IRS)	10
4.5	Basis Swap	12
4.6	OIS	14
4.7	Forward Rate Agreements (FRA).....	15
5.	Algorytm dla Report Tracking Number (RTN) i Trade Id (UTI).....	17
5.1	Budowa identyfikatora RTN i UTI dla ETD	17
5.1.1	Budowa identyfikatorów RTN dla transakcji i transferów (AT=P poziom Tx).....	17
5.1.2	Budowa UTI pozycji dla ETD (AT=N poziom Pos).....	19
5.2	Budowa identyfikatora RTN i UTI dla OTC.....	20
5.2.1	Budowa identyfikatorów dla transakcji (AT=N poziom Tx)	20
6.	Delegowanie obowiązku raportowania.....	21
6.1	Informacje ogólne	21
6.2	Oznaczenie konta rozliczeniowego flagą raportowania (acmt.rqa.002.02).....	22
6.3	Uzupełnienie informacji przy NKK (acmt.rqc.001.03)	22
7.	Raportowanie wyceny i zabezpieczeń.....	24
8.	Zgłaszanie transakcji historycznych.....	25
9.	Terminacja instrumentów pochodnych w dniu ich wygasania	25
10.	Komunikat o zgłoszeniu transakcji - brak informacji o kodzie LEI	25

1. KDPW_CCP - dane kontrahenta

Nazwa: KDPW_CCP SA

Identyfikator LEI: 2594000K576D5CQXI987

Repozytorium transakcji: KDPW

Ze względu na fakt, że kontrahentem KDPW_CCP w transakcjach pochodnych raportowanych do repozytorium w każdym przypadku jest Uczestnik Rozliczający, wszyscy Uczestnicy Rozliczający aktywni na rynku instrumentów pochodnych są zobowiązani do posiadania aktywnego kodu LEI. Informacja o kodzie LEI jest przekazywana przez Uczestnika Rozliczającego do KDPW_CCP jednorazowo, w oświadczeniu dostarczonym zgodnie z wymogami uczestnictwa. Więcej informacji na temat uzyskania kodów LEI nadawanych przez KDPW można znaleźć w serwisie internetowym:

<http://www.kdpw.pl/pl/uslugi/agencja-numerujaca/LEI/Strony/default.aspx>.

2. Wstęp

Celem tego dokumentu jest przedstawienie szczegółowych informacji na temat usługi zgłaszania przez KDPW_CCP do KDPW_TR danych dot. derywatów, opartej na zasadach i procedurach określonych:

- ✓ w rozporządzeniu 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 (zwane dalej rozporządzeniem EMIR),
- ✓ w rozporządzeniu delegowanym Komisji (UE) nr 151/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniającym rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających dane, które mają być publikowane i udostępniane przez repozytoria transakcji, a także standardy operacyjne dotyczące agregowania i porównywania danych oraz dostępu do tych danych, Dz.U. L 52 z 23.2.2013, s. 33–36,
- ✓ w rozporządzeniu wykonawczym Komisji (UE) 2017/105 z dnia 19 października 2016 r. zmieniającym rozporządzenie wykonawcze (UE) nr 1247/2012 ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji, Dz.U. L 17 z 21.1.2017, s. 17–41,
- ✓ w wytycznych w sprawie obliczania pozycji przez repozytoria transakcji na podstawie rozporządzenia EMIR, ESMA70-151-1350,
- ✓ w pytaniach i odpowiedziach (Q&A TR) - Wdrażanie rozporządzenia (UE) nr 648/2012 w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji (EMIR), regularnie uaktualniane na stronie <https://www.esma.europa.eu/>,
- ✓ w Tabeli walidacyjnej
<http://www.kdpw.pl/pl/Repozytorium%20transakcji%20wersa%20EMIR/Strony/Komunikaty-xml.aspx>.

Zakres zgłaszania danych przez KDPW_CCP obejmuje wszystkie transakcje na instrumentach pochodnych rozliczanych przez KDPW_CCP zawartych w obrocie zorganizowanym (ETD) i w obrocie niezorganizowanym (OTC). Wszystkie transakcje w instrumentach pochodnych ETD i OTC zgłaszane są 'trade by trade'. Dodatkowo dla transakcji pochodnych ETD, KDPW_CCP zgłasza *pozycje* na parę kontrahentów, zagregowane na poziomie kontraktów o tej samej charakterystyce (ISIN). Zgłoszone pozycje podlegają codziennej modyfikacji do dnia wygaśnięcia kontraktów.

3. Raporty – szczegółowy opis przekazywania danych do KDPW_TR

3.1 Transakcje i pozycje

W tej części opisano sposób, w jaki sposób KDPW_CCP wypełnia pola tabeli 1 'Dane dotyczące kontrahenta' dla KDPW_CCP. Pozostałe raporty (nie za CCP) mogą zawierać inne wartości.

Trade&Positon					
Table	Field no	Field Name	Trade level value	Position level value	Matching / Pairing field
1	1	Reporting timestamp	[Data i godzina zgłoszenia do RT]		N
1	2	Reporting Counterparty ID ¹	LEI KDPW_CCP: 2594000K576D5CQXI987		Y
1	3	Type of ID of the other Counterparty	'LEI'		N
1	4	ID of the other Counterparty ²	kod LEI UR		Y
1	5	Country of the other Counterparty	Kod kraju kontrahenta		N
1	6	Corporate sector of the reporting counterparty ³	[puste]		N
1	7	Nature of the reporting counterparty ⁴	'C'		N
1	8	Broker ID	[puste]		N
1	9	Report submitting entity ID ⁵	[puste]		N
1	10	Clearing member ID ⁶	[puste]		N
1	11	Type of ID of the Beneficiary	'LEI'		N
1	12	Beneficiary ID ⁷	2594000K576D5CQXI987		N
1	13	Trading capacity	'P'		N
1	14	Counterparty side	'B', jeżeli CCP jest kupującym, 'S', gdzie CCP jest sprzedającym	'B', jeżeli pozycja jest krótka lub pozycja =0, 'S', jeżeli pozycja jest długa lub pozycja =0	Y
1	15	Directly linked to commercial activity or treasury financing	[puste]		N

¹ Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego, brokera lub klienta uczestnika rozliczającego należy wskazać kod LEI podmiotu.

² Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego, brokera lub klienta uczestnika rozliczającego należy wskazać kod LEI lub inny identyfikator podmiotu.

³ Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego, brokera lub klienta uczestnika rozliczającego należy wskazać branżę podmiotu, zgodnie z Rozporządzeniem wykonawczym Komisji (UE) 2017/105 z dnia 19 października 2016 r.

⁴ Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego, brokera lub klienta uczestnika rozliczającego należy wskazać charakter podmiotu, zgodnie z Rozporządzeniem wykonawczym Komisji (UE) 2017/105 z dnia 19 października 2016 r.

⁵ Identyfikator podmiotu dokonującego zgłoszenia - delegowanie raportowania.

⁶ Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego, pole zostaje puste. Jeżeli zgłoszenie dotyczy brokera lub klienta uczestnika rozliczającego, pole należy wypełnić LEI uczestnika rozliczającego.

⁷ Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego, brokera lub klienta uczestnika rozliczającego należy wskazać kod LEI podmiotu.

1	16	Clearing threshold	[puste]	N
1	17	Value of contract	[puste]	N
1	18	Currency of the value	[puste]	N
1	19	Valuation timestamp	[puste]	N
1	20	Valuation type	[puste]	N
1	21	Collateralisation	'OC'	N
1	22	Collateral portfolio	'Y'	N
1	23	Collateral portfolio code	kod portfela zabezpieczeń transakcji/pozycji	N
1	24	Initial margin posted	[puste]	N
1	25	Currency of the initial margin posted	[puste]	N
1	26	Variation margin posted	[puste]	N
1	27	Currency of the variation margins posted	[puste]	N
1	28	Initial margin received	[puste]	N
1	29	Currency of the initial margin	[puste]	N
1	30	received	[puste]	N
1	31	Variation margin received	[puste]	N
1	32	Currency of the variation margins received	[puste]	N
1	33	Excess collateral posted	[puste]	N
1	34	Currency of the excess collateral posted	[puste]	N
1	35	Excess collateral received	[puste]	N

3.2 Wycena

KDPW_CCP przekazuje informację o wycenie na poziomie transakcji dla instrumentów pochodnych OTC. Dla kontraktów pochodnych ETD wycena jest zbiorcza dedykowanym komunikatem – na każdy kod ISIN instrumentu pochodnego.

Counterparty Data Valuations & Collateral				
Table	Field no	Field Name	Trade level value	Matching / Pairing field
1	1	Reporting timestamp	[Data i godzina zgłoszenia do RT]	N
1	2	Reporting Counterparty ID	LEI KDPW_CCP - 2594000K576D5CQXI987	Y
1	3	Type of ID of the other Counterparty	LEI	N
1	4	ID of the other Counterparty	LEI	Y
1	5	Country of the other Counterparty	[puste]	N
1	6	Corporate sector of the reporting counterparty	[puste]	N
1	7	Nature of the reporting counterparty	[puste]	N
1	8	Broker ID	[puste]	N
1	9	Report submitting entity ID	[puste]	N
1	10	Clearing member ID	[puste]	N
1	11	Type of ID of the Beneficiary	[puste]	N
1	12	Beneficiary ID	[puste]	N
1	13	Trading capacity	[puste]	N
1	14	Counterparty side	[puste]	Y
1	15	Directly linked to commercial activity or treasury financing	[puste]	N
1	16	Clearing threshold	[puste]	N
1	17	Value of contract	wycena kontraktu wg wartości rynkowej	N

1	18	Currency of the value	'PLN' lub 'EUR'	N
1	19	Valuation timestamp	YYYY-MM-DDT23:59:00Z - UTC	N
1	20	Valuation type	'C'	N
1	21	Collateralisation	[puste]	N
1	22	Collateral portfolio	[puste]	N
1	23	Collateral portfolio code	[puste]	N
1	24	Initial margin posted	[puste]	N
1	25	Currency of the initial margin posted	[puste]	N
1	26	Variation margin posted	[puste]	N
1	27	Currency of the variation margins posted	[puste]	N
1	28	Initial margin received	[puste]	N
1	29	Currency of the initial margin received	[puste]	N
1	30	Variation margin received	[puste]	N
1	31	Currency of the variation margins received	[puste]	N
1	32	Excess collateral posted	[puste]	N
1	33	Currency of the excess collateral posted	[puste]	N
1	34	Excess collateral received	[puste]	N
1	35	Currency of the excess collateral received	[puste]	N

3.3 Zabezpieczenie

Informacje o zabezpieczeniu są przekazywane na poziomie portfela zabezpieczeń, dla ETD na poziomie pozycji, dla OTC na poziomie transakcji.

Counterparty Data Valuations & Collateral					
Table	Field no	Field Name	Trade level value	Position level value	Matching / Pairing field
1	1	Reporting timestamp	[Data i godzina zgłoszenia do RT]		N
1	2	Reporting Counterparty ID	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQXI987		Y
1	3	Type of ID of the other Counterparty	'LEI'		N
1	4	ID of the other Counterparty	2594000K576D5CQXI987		Y
1	5	Country of the other Counterparty	[puste]		N
1	6	Corporate sector of the reporting counterparty	[puste]		N
1	7	Nature of the reporting counterparty	[puste]		N
1	8	Broker ID	[puste]		N
1	9	Report submitting entity ID	[puste]		N
1	10	Clearing member ID	[puste]		N
1	11	Type of ID of the Beneficiary	[puste]		N
1	12	Beneficiary ID	[puste]		N
1	13	Trading capacity	[puste]		N
1	14	Counterparty side	[puste]		Y
1	15	Directly linked to commercial activity or treasury financing	[puste]		N
1	16	Clearing threshold	[puste]		N
1	17	Value of contract	[puste]		N
1	18	Currency of the value	[puste]		N
1	19	Valuation timestamp	[puste]		N
1	20	Valuation type	[puste]		N
1	21	Collateralisation	'PC' ⁸	'PC'	
1	22	Collateral portfolio	'Y'	'Y'	

⁸ Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego pole przyjmuje wartość 'OC'. Szczegóły walidacji zgłaszanych zabezpieczeń do RT znajdują się w tabeli walidacyjnej ESMA.

1	23	Collateral portfolio code	Kod portfela zabezpieczeń ⁹	N
1	24	Initial margin posted	[puste]	N
1	25	Currency of the initial margin posted	[puste]	N
1	26	Variation margin posted	Suma wartości VM wypłaconego przez KDPW_CCP	N
1	27	Currency of the variation margins posted	'PLN'	N
1	28	Initial margin received	Suma wartości depozytu zabezpieczającego otrzymanego przez KDPW_CCP	N
1	29	Currency of the initial margin received	'PLN'	N
1	30	Variation margin received	Suma wartości VM otrzymanego przez KDPW_CCP	N
1	31	Currency of the variation margins received	'PLN'	N
1	32	Excess collateral posted	[puste]	N
1	33	Currency of the excess collateral posted	[puste]	N
1	34	Excess collateral received	Suma wartości depozytu rozliczeniowego otrzymanego przez KDPW_CCP	N
1	35	Currency of the excess collateral received	'PLN'	N

4. Sposób wypełniania poszczególnych pól w raportach

4.1 Kontrakty terminowe na indeksy i na akcje

Index Futures & Equity Futures					
Table	Field no	Field Name	Trade level value	Position level value	Matching / Pairing field
Section 2a - Contract type					
2	1	Contract type	'FU'		Y
2	2	Asset class	'EQ'		Y
Section 2b - Contract information					
2	3	Product classification type	'C'		Y
2	4	Product classification	Kod CFI		Y
2	5	Product identification type	'I'		Y
2	6	Product identification	Kod ISIN		Y
2	7	Underlying identification type	'I' lub 'X'		Y
2	8	Underlying identification	Kod ISIN		Y
2	9	Notional currency 1	Waluta kontraktu		Y
2	10	Notional currency 2	[puste]		Y
2	11	Deliverable currency	[puste]		N
Section 2c - Details on the transaction					
2	12	Trade ID	UTI transakcji	UTI pozycji	Y
2	13	Report tracking number	RTN	[puste]	N
2	14	Complex trade component ID	[puste]	[puste]	N
2	15	Venue of execution	MIC ¹⁰		Y
2	16	Compression	'N'	'N'	Y
2	17	Price / rate	Kurs zawarcia transakcji lub kurs rozliczeniowy dla transferów	Kurs rozliczeniowy kontraktu	Y
2	18	Price notation	'U'		Y

⁹ Dla ETD – ETD+kod uczestnika, dla OTC – kod uczestnika+id konta PB. Jeżeli zgłoszenie dotyczy uczestnika rozliczającego, brokera lub klienta uczestnika rozliczającego, identyfikator portfela nadawany jest zgodnie opisem w rozdziale 7. Raportowanie wyceny i zabezpieczeń.

¹⁰ WDER – dla transakcji ETD, XOFF – dla transferów

2	19	Currency of price	Waluta		Y
2	20	Notional	Wartość kontraktu		Y
2	21	Price multiplier	Wolumen kontraktów		Y
2	22	Quantity	Liczba kontraktów	Liczba kontraktów	Y
2	23	Up-front payment	[puste]		N
2	24	Delivery type	'C'		Y
2	25	Execution timestamp	Data i czas rozliczenia	YYYY-MM-DDT23:59:00Z	Y
2	26	Effective date	Data rozliczenia	[puste]	Y
2	27	Maturity date	Data wygaśnięcia kontraktu		Y
2	28	Termination date	Data rozliczenia	[puste]	Y
2	29	Settlement date	[puste]		N
2	30	Master Agreement type	[puste]		N
2	31	Master Agreement version	[puste]		N
Section 2d - Risk mitigation / Reporting					
2	32	Confirmation timestamp	Data i czas rozliczenia	[puste]	Y
2	33	Confirmation means	'E'	[puste]	Y
Section 2e – Clearing					
2	34	Clearing obligation	[puste]	[puste]	Y
2	35	Cleared	'Y'	'Y'	Y
2	36	Clearing timestamp	Data i czas rozliczenia	YYYY-MM-DDT23:59:00Z	Y
2	37	CCP	2594000K576D5CQXI987		Y
2	38	Intragroup	[puste]	'N'	N
Section 2f - Interest Rates					
2	39-60	Section not applicable, all fields [puste]			
Section 2g - Foreign Exchange					
2	61-64	Section not applicable, all fields [puste]			
Section 2h - Commodities and emission allowances					
2	65-77	Section not applicable, all fields [puste]			
Section 2i – Options					
2	78-82	Section not applicable, all fields [puste]			
Section 2j - Credit derivatives					
2	83-92	Section not applicable, all fields [puste]			
Section 2k - Modifications to the contract					
2	93	Action type	'P'	'N' or 'M'	
2	94	Level	'T'	'P'	

4.2 Opcje na indeks WIG20

Options					
Table	Field no	Field Name	Trade level value	Position level value	Matching / Pairing field
Section 2a - Contract type					
2	1	Contract type	'OP'		Y
2	2	Asset class	'EQ'		Y
Section 2b - Contract information					
2	3	Product classification type	"C"		Y
2	4	Product classification	Kod CFI		Y
2	5	Product identification type	'I'		Y
2	6	Product identification	Kod ISIN		Y
2	7	Underlying identification type	'X'		Y
2	8	Underlying identification	ISIN		Y
2	9	Notional currency 1	Waluta		Y

2	10	Notional currency 2	[puste]		Y
2	11	Deliverable currency	[puste]		N
Section 2c - Details on the transaction					
2	12	Trade ID	UTI transakcji	UTI pozycji	Y
2	13	Report tracking number	RTN	[puste]	N
2	14	Complex trade component ID	[puste]	[puste]	N
2	15	Venue of execution	MIC ¹¹		Y
2	16	Compression	'N'	'Y'	Y
2	17	Price / rate	Kurs zawarcia transakcji lub kurs zamknięcia opcji dla transferów	Kurs zamknięcia opcji	Y
2	18	Price notation	'U'		Y
2	19	Currency of price	Waluta		Y
2	20	Notional	Wartość nominalna		Y
2	21	Price multiplier	Mnożnik		Y
2	22	Quantity	Liczba opcji	Liczba opcji	Y
2	23	Up-front payment	[puste]		N
2	24	Delivery type	'C'		Y
2	25	Execution timestamp	Data i czas rozliczenia	YYYY-MM-DDT23:59:00Z	Y
2	26	Effective date	Data rozliczenia	[puste]	Y
2	27	Maturity date	Data wygaśnięcia opcji		Y
2	28	Termination date	Data rozliczenia	[puste]	Y
2	29	Settlement date	[puste]		N
2	30	Master Agreement type	[puste]		N
2	31	Master Agreement version	[puste]		N
Section 2d - Risk mitigation / Reporting					
2	32	Confirmation timestamp	Data i czas rozliczenia	[puste]	Y
2	33	Confirmation means	'E'	[puste]	Y
Section 2e – Clearing					
2	34	Clearing obligation	[puste]	[puste]	Y
2	35	Cleared	'Y'	'Y'	Y
2	36	Clearing timestamp	Data i czas rozliczenia	YYYY-MM-DDT23:59:00Z	Y
2	37	CCP	2594000K576D5CQXI987		Y
2	38	Intragroup	[puste]	'N'	N
Section 2f - Interest Rates					
2	39-60	Section not applicable, all fields [blank]			
Section 2g - Foreign Exchange					
2	61-64	Section not applicable, all fields [blank]			
Section 2h - Commodities and emission allowances					
2	65-77	Section not applicable, all fields [blank]			
Section 2i – Options					
2	78	Option type	'P' lub 'C'		Y
2	79	Option exercise style	'E'		Y
2	80	Strike price (cap/floor rate)	Cena wykonania kontraktu		Y
2	81	Strike price notation	'U' lub 'Y'		Y
2	82	Maturity date of the underlying	[puste]		Y
Section 2j - Credit derivatives					
		Section not applicable, all fields [blank]			
Section 2k - Modifications to the contract					
2	93	Action type	'P'	'N' lub 'M'	
2	94	Level	'T'	'P'	

¹¹ WDER – dla transakcji ETD, XOFF – dla transferów instrumentów pochodnych ETD

4.3 Kontrakty terminowe na kursy waluty

Currency futures						
Table	Field no	Field Name	Trade level value		Position level value	Matching / Pairing field
Section 2a - Contract type						
2	1	Contract type	'FU'			Y
2	2	Asset class	'CU'			Y
Section 2b - Contract information						
2	3	Product classification type	'C'			Y
2	4	Product classification	Kod CFI			Y
2	5	Product identification type	'I'			Y
2	6	Product identification	Kod ISIN			Y
2	7	Underlying identification type	'I'			Y
2	8	Underlying identification	Kod ISIN			Y
2	9	Notional currency 1	Waluta			Y
2	10	Notional currency 2	[puste]			Y
2	11	Deliverable currency	[puste]			N
Section 2c - Details on the transaction						
2	12	Trade ID	UTI transakcji	UTI pozycji		Y
2	13	Report tracking number	RTN	[puste]		N
2	14	Complex trade component ID	[puste]	[puste]		N
2	15	Venue of execution	MIC ¹²			Y
2	16	Compression	'N'	'Y'		Y
2	17	Price / rate	Kurs zawarcia transakcji lub kurs rozliczeniowy	Kurs rozliczeniowy kontraktu		Y
2	18	Price notation	'U'			Y
2	19	Currency of price	Waluta			Y
2	20	Notional	Wartość nominalna			Y
2	21	Price multiplier	Mnożnik			Y
2	22	Quantity	Liczba kontraktów	Liczba kontraktów		Y
2	23	Up-front payment	[puste]			N
2	24	Delivery type	'C'			Y
2	25	Execution timestamp	Data i czas rozliczenia	YYYY-MM-DDT23:59:00Z		Y
2	26	Effective date	Data rozliczenia	[puste]		Y
2	27	Maturity date	Data wygaśnięcia kontraktu			
2	28	Termination date	Data rozliczenia	[puste]		Y
2	29	Settlement date	[puste]			N
2	30	Master Agreement type	[puste]			N
2	31	Master Agreement version	[puste]			N
Section 2d - Risk mitigation / Reporting						
2	32	Confirmation timestamp	Data i czas rozliczenia	[puste]		Y
2	33	Confirmation means	'E'	[puste]		Y
Section 2e – Clearing						
2	34	Clearing obligation	[puste]	[puste]		Y
2	35	Cleared	'Y'	'Y'		Y
2	36	Clearing timestamp	Data i czas rozliczenia	YYYY-MM-DDT23:59:00Z		Y
2	37	CCP	2594000K576D5CQXI987			Y

¹² WDER – dla transakcji ETD, XOFF – dla transferów

2	38	Intragroup	[puste]	'N'	N
<i>Section 2f - Interest Rates</i>					
2	39-60	Section not applicable, all fields [puste]			
<i>Section 2g - Foreign Exchange</i>					
2	61	Delivery currency 2	[puste]	[puste]	N
2	62	Exchange rate 1	Kod waluty kontraktu	Kod waluty kontraktu	Y
2	63	Forward exchange rate	Kurs waluty	Kurs waluty	Y
2	64	Exchange rate basis	Kod waluty	Kod waluty	Y
<i>Section 2h - Commodities and emission allowances</i>					
2	65-77	Section not applicable, all fields [puste]			
<i>Section 2i - Options</i>					
2	78-82	Section not applicable, all fields [puste]			
<i>Section 2j - Credit derivatives</i>					
		Section not applicable, all fields [blank]			
<i>Section 2k - Modifications to the contract</i>					
2	93	Action type	'P'	'N' lub 'M'	
2	94	Level	'T'	'p'	

4.4 Interest Rate Swaps (IRS)

<i>Interest Rate Swaps</i>				
Table	Field no	Field name	Trade level value	Matching / Pairing field
<i>Section 2a - Contract type</i>				
2	1	Contract type	'SW'	Y
2	2	Asset class	'IR'	Y
<i>Section 2b - Contract information</i>				
2	3	Product classification type	'C'	Y
2	4	Product classification	'SRXXXX'	Y
2	5	Product identification type	[puste]	Y
2	6	Product identification	[puste]	Y
2	7	Underlying identification type	'I'	Y
2	8	Underlying identification	kod ISIN	Y
2	9	Notional currency 1	Waluta	Y
2	10	Notional currency 2	[puste]	Y
2	11	Deliverable currency	[puste]	N
<i>Section 2c - Details on the transaction</i>				
2	12	Trade ID	UTI transakcji	Y
2	13	Report tracking number	RTN	N
2	14	Complex trade component ID	[puste]	N
2	15	Venue of execution	'XXXX'	Y
2	16	Compression	'N'	Y
2	17	Price / rate	Stopa z transakcji	Y
2	18	Price notation	'X'	Y
2	19	Currency of price	[puste]	Y
2	20	Notional	Nominał transakcji	Y
2	21	Price multiplier	'1'	Y
2	22	Quantity	'1'	Y
2	23	Up-front payment	[puste]	N
2	24	Delivery type	'C'	Y
2	25	Execution timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	26	Effective date	Data nowacji	Y
2	27	Maturity date	Data wygaśnięcia kontraktu	Y
2	28	Termination date	[puste]	Y

2	29	Settlement date	[puste]	N
2	30	Master Agreement type	[puste]	N
2	31	Master Agreement version	[puste]	N
<i>Section 2d - Risk mitigation / Reporting</i>				
2	32	Confirmation timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	33	Confirmation means	'E'	Y
<i>Section 2e – Clearing</i>				
2	34	Clearing obligation	'Y'	Y
2	35	Cleared	'Y'	Y
2	36	Clearing timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	37	CCP	2594000K576D5CQXI987	Y
2	38	Intragroup	'N'	N
<i>Section 2f - Interest Rates</i>				
2	39	Fixed rate of leg 1	Stawka transakcyjna	Y
2	40	Fixed rate of leg 2	[puste]	Y
2	41	Fixed rate day count leg 1	'30/360', 'Actual/360', 'ACTUAL/365', 'ACTUAL/ACTUAL'	N
2	42	Fixed rate day count leg 2	[puste]	N
2	43	Fixed rate payment frequency leg 1: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	44	Fixed rate payment frequency leg 1: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	45	Fixed rate payment frequency leg 2: time period	[puste]	N
2	46	Fixed rate payment frequency leg 2: multiplier	[puste]	N
2	47	Floating rate payment frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	48	Floating rate payment frequency leg 1: multiplier	[puste]	N
2	49	Floating rate payment frequency leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	50	Floating rate payment frequency leg 2: multiplier	1M='1', 3M='4', 6M='2', 12M='1', T='1'	N
2	51	Floating rate reset frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	52	Floating rate reset frequency leg 1: multiplier	[puste]	N
2	53	Floating rate reset frequency leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	54	Floating rate reset frequency leg 2: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	55	Floating rate of leg 1	[puste]	N
2	56	Floating rate reference period leg 1: time period	[puste]	N
2	57	Floating rate reference period leg 1: multiplier	[puste]	N
2	58	Floating rate of leg 2	WIBO, PLNA, EURI, ESTR, EONA	N
2	59	Floating rate reference period leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	60	Floating rate reference period leg 2: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N

Section 2g - Foreign Exchange				
2	61-64	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2h - Commodities and emission allowances				
2	65-77	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2i – Options				
2	78-82	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2j - Credit derivatives				
2	83-92	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2k - Modifications to the contract				
2	93	Action type	“N”	
2	94	Level	“T”	

4.5 Basis Swap

Interest Rate Swaps				
Table	Field no	Field name	Trade level value	Matching / Pairing field
Section 2a - Contract type				
2	1	Contract type	'SW'	Y
2	2	Asset class	'IR'	Y
Section 2b - Contract information				
2	3	Product classification type	'C'	Y
2	4	Product classification	'SRXXXX'	Y
2	5	Product identification type	[puste]	Y
2	6	Product identification	[puste]	Y
2	7	Underlying identification type	'I'	Y
2	8	Underlying identification	kod ISIN	Y
2	9	Notional currency 1	Waluta	Y
2	10	Notional currency 2	[puste]	Y
2	11	Deliverable currency	[puste]	N
Section 2c - Details on the transaction				
2	12	Trade ID	UTI transakcji	Y
2	13	Report tracking number	RTN	N
2	14	Complex trade component ID	[puste]	N
2	15	Venue of execution	'XXXX'	Y
2	16	Compression	'N'	Y
2	17	Price / rate	'9999999999999999.99999'	Y
2	18	Price notation	'X'	Y
2	19	Currency of price	[puste]	Y
2	20	Notional	Nominał transakcji	Y
2	21	Price multiplier	'1'	Y
2	22	Quantity	'1'	Y
2	23	Up-front payment	[puste]	N
2	24	Delivery type	'C'	Y
2	25	Execution timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	26	Effective date	Data nowacji	Y
2	27	Maturity date	Data wygaśnięcia kontraktu	Y
2	28	Termination date	[puste]	Y
2	29	Settlement date	[puste]	N
2	30	Master Agreement type	[puste]	N
2	31	Master Agreement version	[puste]	N
Section 2d - Risk mitigation / Reporting				
2	32	Confirmation timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	33	Confirmation means	'E'	Y
Section 2e – Clearing				

2	34	Clearing obligation	'Y'	Y
2	35	Cleared	'Y'	Y
2	36	Clearing timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	37	CCP	2594000K576D5CQXI987	Y
2	38	Intragroup	'N'	N
<i>Section 2f - Interest Rates</i>				
2	39	Fixed rate of leg 1	[puste]	Y
2	40	Fixed rate of leg 2	[puste]	Y
2	41	Fixed rate day count leg 1	[puste]	N
2	42	Fixed rate day count leg 2	[puste]	N
2	43	Fixed rate payment frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	44	Fixed rate payment frequency leg 1: multiplier	[puste]	N
2	45	Fixed rate payment frequency leg 2: time period	[puste]	N
2	46	Fixed rate payment frequency leg 2: multiplier	[puste]	N
2	47	Floating rate payment frequency leg 1: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	48	Floating rate payment frequency leg 1: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	49	Floating rate payment frequency leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	50	Floating rate payment frequency leg 2: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	51	Floating rate reset frequency leg 1: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	52	Floating rate reset frequency leg 1: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	53	Floating rate reset frequency leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	54	Floating rate reset frequency leg 2: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	55	Floating rate of leg 1	WIBO, PLNA, EURI, ESTR, EONA	N
2	56	Floating rate reference period leg 1: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	57	Floating rate reference period leg 1: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	58	Floating rate of leg 2	WIBO, PLNA, EURI, ESTR, EONA	N
2	59	Floating rate reference period leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	60	Floating rate reference period leg 2: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
<i>Section 2g - Foreign Exchange</i>				
2	61-64	Section not applicable, all fields [puste]		
<i>Section 2h - Commodities and emission allowances</i>				
2	65-77	Section not applicable, all fields [puste]		
<i>Section 2i - Options</i>				

2	78-82	Section not applicable, all fields [puste]	
<i>Section 2j - Credit derivatives</i>			
2	83-92	Section not applicable, all fields [puste]	
<i>Section 2k - Modifications to the contract</i>			
2	93	Action type	"N"
2	94	Level	"T"

4.6 OIS

<i>Interest Rate Swaps</i>				
Table	Field no	Field name	Trade level value	Matching / Pairing field
<i>Section 2a - Contract type</i>				
2	1	Contract type	'SW'	Y
2	2	Asset class	'IR'	Y
<i>Section 2b - Contract information</i>				
2	3	Product classification type	'C'	Y
2	4	Product classification	'SRXXXX'	Y
2	5	Product identification type	[puste]	Y
2	6	Product identification	[puste]	Y
2	7	Underlying identification type	'I'	Y
2	8	Underlying identification	kod ISIN	Y
2	9	Notional currency 1	Waluta	Y
2	10	Notional currency 2	[puste]	Y
2	11	Deliverable currency	[puste]	N
<i>Section 2c - Details on the transaction</i>				
2	12	Trade ID	UTI transakcji	Y
2	13	Report tracking number	RTN	N
2	14	Complex trade component ID	[puste]	N
2	15	Venue of execution	'XXXX'	Y
2	16	Compression	'N'	Y
2	17	Price / rate	Stopa z transakcji	Y
2	18	Price notation	'X'	Y
2	19	Currency of price	[puste]	Y
2	20	Notional	Nominał transakcji	Y
2	21	Price multiplier	'1'	Y
2	22	Quantity	'1'	Y
2	23	Up-front payment	[puste]	N
2	24	Delivery type	'C'	Y
2	25	Execution timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	26	Effective date	Data nowacji	Y
2	27	Maturity date	Data wygaśnięcia kontraktu	Y
2	28	Termination date	[puste]	Y
2	29	Settlement date	[puste]	N
2	30	Master Agreement type	[puste]	N
2	31	Master Agreement version	[puste]	N
<i>Section 2d - Risk mitigation / Reporting</i>				
2	32	Confirmation timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	33	Confirmation means	'E'	Y
<i>Section 2e - Clearing</i>				
2	34	Clearing obligation	'Y'	Y
2	35	Cleared	'Y'	Y
2	36	Clearing timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	37	CCP	2594000K576D5CQXI987	Y
2	38	Intragroup	'N'	N

Section 2f - Interest Rates				
2	39	Fixed rate of leg 1	Stawka transakcyjna	Y
2	40	Fixed rate of leg 2	[puste]	Y
2	41	Fixed rate day count leg 1	‘30/360’, ‘Actual/360’, ‘ACTUAL/365’, ‘ACTUAL/ACTUAL’	N
2	42	Fixed rate day count leg 2	[puste]	N
2	43	Fixed rate payment frequency leg 1: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	44	Fixed rate payment frequency leg 1: multiplier	‘1’	N
2	45	Fixed rate payment frequency leg 2: time period	[puste]	N
2	46	Fixed rate payment frequency leg 2: multiplier	[puste]	N
2	47	Floating rate payment frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	48	Floating rate payment frequency leg 1: multiplier	[puste]	N
2	49	Floating rate payment frequency leg 2: time period	‘D’	N
2	50	Floating rate payment frequency leg 2: multiplier	‘1’	N
2	51	Floating rate reset frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	52	Floating rate reset frequency leg 1: multiplier	[puste]	N
2	53	Floating rate reset frequency leg 2: time period	‘D’	N
2	54	Floating rate reset frequency leg 2: multiplier	‘1’	N
2	55	Floating rate of leg 1	[puste]	N
2	56	Floating rate reference period leg 1: time period	[puste]	N
2	57	Floating rate reference period leg 1: multiplier	[puste]	N
2	58	Floating rate of leg 2	WIBO, PLNA, EURI, ESTR, EONA	N
2	59	Floating rate reference period leg 2: time period	‘D’	N
2	60	Floating rate reference period leg 2: multiplier	‘1’	N
Section 2g - Foreign Exchange				
2	61-64	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2h - Commodities and emission allowances				
2	65-77	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2i – Options				
2	78-82	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2j - Credit derivatives				
2	83-92	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2k - Modifications to the contract				
2	93	Action type	“N”	
2	94	Level	“T”	

4.7 Forward Rate Agreements (FRA)

Forward Rate Agreements	
-------------------------	--

Table	Field no	Field name	Trade level value	Matching / Pairing field
<i>Section 2a - Contract type</i>				
2	1	Contract type	"FR"	Y
2	2	Asset class	"IR"	Y
<i>Section 2b - Contract information</i>				
2	3	Product classification type	"C"	Y
2	4	Product classification	JRXXXX	Y
2	5	Product identification type	[puste]	Y
2	6	Product identification	[puste]	Y
2	7	Underlying identification type	[puste]	Y
2	8	Underlying identification	[puste]	Y
2	9	Notional currency 1	Waluta	Y
2	10	Notional currency 2	[puste]	Y
2	11	Deliverable currency	[puste]	N
<i>Section 2c - Details on the transaction</i>				
2	12	Trade ID	UTI transakcji	Y
2	13	Report tracking number	RTN	N
2	14	Complex trade component ID	[puste]	N
2	15	Venue of execution	'XXXX'	Y
2	16	Compression	"N"	Y
2	17	Price / rate	stawka z transakcji	Y
2	18	Price notation	"X"	Y
2	19	Currency of price	[puste]	Y
2	20	Notional	Wartość nominalna	Y
2	21	Price multiplier	"1"	Y
2	22	Quantity	"1"	Y
2	23	Up-front payment	[puste]	N
2	24	Delivery type	'C'	Y
2	25	Execution timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	26	Effective date	Data nowacji	Y
2	27	Maturity date	Data wygaśnięcia kontraktu	Y
2	28	Termination date	[puste]	Y
2	29	Settlement date	[puste]	N
2	30	Master Agreement type	[puste]	N
2	31	Master Agreement version	[puste]	N
<i>Section 2d - Risk mitigation / Reporting</i>				
2	32	Confirmation timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	33	Confirmation means	"E"	Y
<i>Section 2e - Clearing</i>				
2	34	Clearing obligation	"Y"	Y
2	35	Cleared	"Y"	Y
2	36	Clearing timestamp	Data i czas nowacji	Y
2	37	CCP	2594000K576D5CQXI987	Y
2	38	Intragroup	"N"	N
<i>Section 2f - Interest Rates</i>				
2	39	Fixed rate of leg 1	Stawka transakcyjna	Y
2	40	Fixed rate of leg 2	[puste]	Y
2	41	Fixed rate day count leg 1	'30/360', 'Actual/360', 'ACTUAL/365', 'ACTUAL/ACTUAL'	N
2	42	Fixed rate day count leg 2	[puste]	N
2	43	Fixed rate payment frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	44	Fixed rate payment frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	45	Fixed rate payment frequency leg 2: time period	[puste]	N
2	46	Fixed rate payment frequency leg 2: multiplier	[puste]	N

2	47	Floating rate payment frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	48	Floating rate payment frequency leg 1: multiplier	[puste]	N
2	49	Floating rate payment frequency leg 2: time period	[puste]	N
2	50	Floating rate payment frequency leg 2: multiplier	[puste]	N
2	51	Floating rate reset frequency leg 1: time period	[puste]	N
2	52	Floating rate reset frequency leg 1: multiplier	[puste]	N
2	53	Floating rate reset frequency leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	54	Floating rate reset frequency leg 2: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1', T='1'	N
2	55	Floating rate of leg 1	[puste]	N
2	56	Floating rate reference period leg 1: time period	[puste]	N
2	57	Floating rate reference period leg 1: multiplier	[puste]	N
2	58	Floating rate of leg 2	'WIBO', 'PLNA', 'EURI', 'ESTR', 'EONA'	N
2	59	Floating rate reference period leg 2: time period	Y = rok, M = miesiąc, D = Dzień	N
2	60	Floating rate reference period leg 2: multiplier	1M='1', 3M='3', 6M='6', 12M='1' T='1'	N
Section 2g - Foreign Exchange				
2	61-64	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2h - Commodities and emission allowances				
2	65-77	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2i – Options				
2	78-82	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2j - Credit derivatives				
2	83-92	Section not applicable, all fields [puste]		
Section 2k - Modifications to the contract				
2	93	Action type	“N”	
2	94	Level	“T”	

5. Algorytm dla Report Tracking Number (RTN) i Trade Id (UTI)

5.1 Budowa identyfikatora RTN i UTI dla ETD

5.1.1 Budowa identyfikatorów RTN dla transakcji i transferów (AT=P poziom Tx)

Transakcja raportowana do repozytorium jest oznaczona unikalnym identyfikatorem RTN (Report Tracking Number). Do budowy identyfikatora RTN, KDPW_CCP będzie wykorzystywał przekazywany w transakcji przez GPW identyfikator transakcji MktRef. Identyfikator ten jest unikalny wyłącznie dla określonej daty zawarcia transakcji, kodu ISIN instrumentu i kodu rynku, na którym zawarto transakcję. Identyfikator RTN powinien być unikalny dla każdej transakcji powstałej po nowacji. W związku z powyższym KDPW_CCP dla budowy identyfikatora RTN wykorzysta następujący algorytm:

Algorytm budowy identyfikatora RTN dla nowej transakcji

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
1-10	10	E01MIC KDPW_CCP000	E01KDPW000
11	1	Kod rynku	E

12	1	Strona transakcji dla UR (przed nowacją)	B/S
13-20	8	Data zawarcia transakcji	RRRRMMDD
21-32	12	ISIN instrumentu	ISIN
33-(32+N, maks. 8)	N (max.8)	Numer transakcji nadawany przez GPW	MktRef

Przykład:

Strona transakcji: S
(w transakcji po nowacji UR jest Sprzedającym, KDPW_CCP jest Kupującym)
Data zawarcia transakcji: 12.02.2014
ISIN: PLOGF0004663
MktRef: 256
RTN: E01KDPW000ES20140212PLOGF0004663256

Algorytm budowy identyfikatora RTN dla transferu

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
1-40	40	Identyfikator transakcji	RTN
41-52	Max 12	Rozszerzenie UTI	XXX

Przykład:

RTN: E01KDPW000TS20140212PLOGF0004663222203236
Rozszerzenie UTI: 001
Identyfikator UTI: E01KDPW000TS20140212PLOGF0004663222203236001

Dla transakcji giełdowych właściwy identyfikator pary raportów/raportu – identyfikator UTI, budowany jest poprzez dodanie do identyfikatora RTN dla transakcji numeru, opisującego każdą parę zgłoszeń przekazywanych do repozytorium dla danej transakcji, zwanego dalej rozszerzeniem UTI. Identyfikator UTI będzie tworzony poprzez dodanie do identyfikatora RTN ciągu XXX, gdzie 'XXX' oznacza rozszerzenie UTI z tabeli transakcjami.

Raport wg scen.	Zobowiązany do raportowania	UTI	Kontrahent	Kontrahent	UR	Beneficjent	Str. transakcji
1	UR	RTN+001	UR	CCP		UR	'B'
2	CCP	RTN+001	CCP	UR		CCP	'S'
3	BR	RTN+002	BR	UR	UR	BR	'B'
4	UR	RTN+002	UR	BR		UR	'S'
5	CL	RTN+003	CL	BR	UR	CL	'B'
6	BR	RTN+003	BR	CL	UR	BR	'S'

7	UR	RTN+001	UR	CCP		UR	'B'
8	CCP	RTN+001	CCP	UR		CCP	'S'
9	CL	RTN+004	CL	UR	UR	CL	'B'
10	UR	RTN+004	UR	CL		UR	'S'
11	CL	RTN+005	CL	CCP	UR	CL	'B'
12	CCP	RTN+005	CCP	CL		CCP	'S'

Do budowy identyfikatora UTI dla transakcji wykorzystany zostaje następujący algorytm:

Algorytm budowy identyfikatora UTI dla Transakcji

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
1-40	40	Identyfikator transakcji	RTN
41-52	Max 12	Rozszerzenie UTI	XXX

Przykład:

RTN: E01KDPW000ES20140212PL0GF0004663256
 Rozszerzenie UTI: 001
 Identyfikator UTI: E01KDPW000ES20140212PL0GF0004663256001

Dla transferów identyfikator UTI, budowany jest poprzez dodanie do identyfikatora RTN dla transferu numeru rozszerzenia UTI. Identyfikator UTI będzie tworzony poprzez dodanie do identyfikatora RTN ciągu XXX, gdzie 'XXX' oznacza rozszerzenie UTI z tabeli z transferami.

Do budowy identyfikatora UTI dla transferu wykorzystany zostaje następujący algorytm:

Algorytm budowy identyfikatora UTI dla transferu

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
1-40	40	Identyfikator transakcji	RTN
41-52	Max 12	Rozszerzenie UTI	XXX

Przykład:

RTN: E01KDPW000TS20140212PL0GF000466322203236
 Rozszerzenie UTI: 001
 Identyfikator UTI: E01KDPW000TS20140212PL0GF000466322203236001

5.1.2 Budowa UTI pozycji dla ETD (AT=N poziom Pos)

RTN dla pozycji nie będzie budowany, natomiast UTI dla pozycji będzie zbudowany w następujący sposób:

Algorytm budowy identyfikatora UTI dla pozycji

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
---------	---------	------	---------

1-3	3	Stała 'E01'	E01
4-7	4	CCP MIC Code	KDPW
8-10	3	Stała '000'	000
11-14	4	Czteroznakowy kod uczestnika rozliczającego lub kod brokera w zależności od wskaźnika pozycji. Dla 'C' i 'M' -kod UR, dla 'B' i 'O' – kod brokera	09YY
15	1	Stała 'P'	Pozycja
16	1	Wyróżnik pozycji	'B' – broker, 'C' - klient, 'M' – UR, 'O' - inny
17-36	20	Identyfikator kontrahenta (LEI lub NKK) w zależności od wskaźnika pozycji. Dla 'B' i 'M' LEI uczestnika rozliczającego, dla 'C' i 'O' – LEI klienta	LEI lub NKK
37-52	17	ISIN	ABCDEF123456

Przykład UTI dla raportów CCP-UR i UR-CCP:

E01KDPW0000999PMQOH26KWDF7CG10L67920PL0GF0019992

Przykład UTI dla raportów UR-CL i CL-UR:

E01KDPW0000999PCQOH26KWDF7CG10L67920PL0GF0019992

5.2 Budowa identyfikatora RTN i UTI dla OTC

5.2.1 Budowa identyfikatorów dla transakcji (AT=N poziom Tx)

Algorytm budowy Report tracking numer (RTN) dla transakcji OTC ma następujący schemat:

Algorytm budowy identyfikatora RTN dla nowej transakcji

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
1-10	10	E01MIC KDPW_CCP000	E01KDPW000
11	1	Kod rynku	N
12	1	Typ operacji	T, A, U, P
13-20	8	Data operacji	RRRRMMDD
21-n	Max 20	Identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP	wartość atrybutu 'id' w polu 'trade'

Przykład:

Data nowacji transakcji: 04.06.2020

atrybut 'id' w polu 'trade': 478657705

RTN: E01KDPW000NT20200604478657705

Właściwy identyfikator pary raportów/raportu – identyfikator UTI, budowany jest poprzez dodanie do identyfikatora RTN numeru, opisującego każdą parę zgłoszeń przekazywanych do repozytorium dla

danej transakcji, zwanego dalej rozszerzeniem UTI. Identyfikator UTI będzie tworzony poprzez dodanie do identyfikatora RTN cyfr 008 lub 009 (tworząc odpowiednio RTN008 lub RTN009). Rozszerzenie 008 stosowane jest dla zgłoszeń UR – CCP oraz CCP – UR, rozszerzenie 009 natomiast dla zgłoszeń UR – CL oraz CL – UR.

Typ operacji:

T – transakcja z MarkitWire

A – umorzenie częściowe transakcji w systemie rozliczeń

U – transakcja w wyniku aukcji

P – porting transakcji w systemie rozliczeń pomiędzy dwoma uczestnika rozliczającymi

Algorytm Budowy UTI dla transakcji OTC ma następujący schemat:

Algorytm budowy identyfikatora UTI

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
1-N	Max. 40	Identyfikator transakcji	RTN
N+1 – N+3	3	Rozszerzenie UTI	008 lub 009

Przykład:

RTN: E01KDPW000NT20200604478657705
 Rozszerzenie UTI: 008 lub 009
 Identyfikator UTI: E01KDPW000NT20200604478657705008

6. Delegowanie obowiązku raportowania

6.1 Informacje ogólne

KDPW_CCP prowadzi usługę raportowania informacji o transakcjach pochodnych do Repozytorium Transakcji prowadzonego przez KDPW, na zlecenie Uczestnika Rozliczającego. Możliwość delegowania raportowania dotyczy zarówno Uczestników Rozliczających, jak również za ich pośrednictwem - ich Klientów i podmioty zawierające transakcje pochodne na zlecenie ich Klientów (Brokerzy). Delegowanie raportowania na KDPW_CCP odbywa się za pośrednictwem:

- oświadczeń pisemnych składanych przez Uczestników Rozliczających w zakresie delegowania obowiązku tych Uczestników jak również Brokerów, którzy zawierają transakcje na zlecenie ich klientów (wzór oświadczenia w serwisie internetowym KDPW_CCP). W składanym w KDPW_CCP oświadczeniu, Uczestnik Rozliczający w szczególności podaje kod LEI, a także pozostałe informacje wymagane do poprawnego zaraportowania transakcji.

W przypadku delegowania swojego obowiązku raportowania na KDPW_CCP, Uczestnik Rozliczający powinien dodatkowo, docelowo wskazać identyfikatory LEI przy NKK tych swoich Klientów, którzy są zobowiązani do raportowania transakcji na instrumentach pochodnych.

Jeżeli Uczestnik Rozliczający rozlicza transakcje zawarte na zlecenie Klientów przez Brokerów, w oświadczeniu jest zobowiązany do podania powyższych informacji także w odniesieniu do tych

Brokerów, którzy są zobowiązani do raportowania transakcji zgodnie z regulacjami ESMA (występują, jako Investment Firm w scenariuszu nr 1 z Q&A, do pytania nr ETD2).

2. dedykowanych komunikatów XML w zakresie delegowania obowiązku w odniesieniu do kont rozliczeniowych (w tym Klientów, kont pozycji własnych Uczestnika Rozliczającego):
 - a) oznaczenie konta rozliczeniowego flagą raportowania (w przypadku delegowania raportowania, komunikat: acmt.rqa.002.02 Instrukcja dotycząca konta rozliczeniowego),
 - b) uzupełnienie informacji przy NKK (acmt.rqc.001.03 Instrukcja dotycząca NKK).

KDPW_CCP przesyła informacje o transakcjach do repozytorium transakcji w dniu roboczym następującym po dniu, w którym nastąpiło rozliczenie transakcji.

6.2 Oznaczenie konta rozliczeniowego flagą raportowania (acmt.rqa.002.02)

W komunikacie acmt.rqa.002.02, na potrzeby raportowania, zostało dodane pole:

3.3.6 RprtAu Autoryzacja dla KDPW_CCP do raportowania - Y lub N

Określa ono, czy Uczestnik deleguje na KDPW_CCP zgłaszanie kontraktów pochodnych zarejestrowanych na danym koncie rozliczeniowym – w takim przypadku należy flagę raportowania ustawić w wartości 'Y'. Zmiana flagi jest możliwa wyłącznie po wzbogaceniu danych dotyczących raportowania, które znajdują się przy NKK opisanych w ppkt. 6.3.

6.3 Uzupełnienie informacji przy NKK (acmt.rqc.001.03)

Dla właściwego wykonania obowiązku raportowania przez KDPW_CCP w imieniu klientów należy przekazać w komunikacie acmt.rqc.001.03 dodatkowe informacje (co najmniej) :

1) Gdy klient posiada LEI:

- 1.4 EligDt – Data obowiązywania, wskazując to pole określamy od kiedy wskazane w komunikacie wartości będą obowiązywać

- 2.5 LegalSts – Klient instytucjonalny/osoba fizyczna (wskazanie, czy druga strona jest klientem zobowiązanym do raportowania, czy też osobą fizyczną, która nie jest zobowiązana do raportowania. Zgodnie z definicją 'undertaking' przedstawioną w dokumencie Komisji Europejskiej, osoby fizyczne prowadzące działalność gospodarczą są zobowiązane do raportowania),

- 2.8 LEI – kod LEI (podana wartość powinna mieć 20 znaków, KDPW_CCP weryfikuje poprawność ilości znaków),

- 2.10.2.1 Ctry – Kraj rezydencji,

- 2.10.4 FinNonFinInd - Klient finansowy /niefinansowy (F – finansowy, N – niefinansowy),

- 2.10.5 CmmrclActvty - Bezpośredni związek z działalnością gospodarczą lub działalnością w zakresie zarządzania aktywami i pasywami (Y – tak, N - nie),

- 2.10.6 ClrTrshld - Próg wiążący się z obowiązkiem centralnego rozliczania transakcji OTC (dotyczy wyłącznie instytucji niefinansowych; Y – powyżej, N – poniżej),

- 2.10.2.1 Ctry – w przypadku nie podania informacji w polu ‘Kraj rezydencji’, KDPW_CCP uzupełni raport do Repozytorium Transakcji wartością domyślną ‘PL’.

2) Gdy klient nie posiada LEI:

- 2.5 LegalSts – Klient instytucjonalny/osoba fizyczna (Wskazanie, czy druga strona jest klientem zobowiązanym do raportowania, czy też osobą fizyczną, która nie jest zobowiązana do raportowania. Zgodnie z definicją ‘undertaking’ przedstawioną w dokumencie Komisji Europejskiej, osoby fizyczne prowadzące działalność gospodarczą są zobowiązane do raportowania),

- 2.10 CtrPtyAdrAndSctr - Szczegółowe informacje adresowo-branżowe o kontrahencie,

- 2.10.1 Nm - Nazwa klienta,

- 2.10.2 Dmcl - Siedziba klienta,

- 2.10.2.1 Ctry - Kraj rezydencji,

- 2.10.2.2 PstCd - Kod pocztowy,

- 2.10.2.3 TwnNm – Miasto,

- 2.10.2.4 StrtNm – Ulica,

- 2.10.3 CorpSctr – Branża, do której należy klient (nie trzeba wypełniać w przypadku, gdy podmiot jest niefinansowy – pole 2.10.4)

W każdym przypadku należy podać:

- 2.10.4 FinNonFinInd - Klient finansowy/niefinansowy (F – finansowy, N – niefinansowy),

- 2.10.5 CmmrclActvty - Bezpośredni związek z działalnością gospodarczą lub działalnością w zakresie zarządzania aktywami i pasywami (Y – tak, N - nie),

- 2.10.6 ClrTrshld - Próg wiążący się z obowiązkiem centralnego rozliczania transakcji OTC (dotyczy wyłącznie instytucji niefinansowych (Y – powyżej, N – poniżej).

Informacja na temat komunikatów XML znajduje się w serwisie internetowym:

<http://www.kdpwccp.pl/pl/raportowanie%20do%20repozytorium/Strony/Narz%c4%99dzia-IT.aspx>

Warunkiem przekazania przez KDPW_CCP informacji o transakcjach zgodnie z dokonany zgłoszeniem delegowania obowiązku raportowania, jest skuteczne dostarczenie oświadczeń/komunikatów XML na jeden dzień przed dniem zawarcia transakcji, które mają zostać zaraportowane przez KDPW_CCP.

Dostęp do informacji przekazanych przez KDPW_CCP w ramach usługi pośredniczenia w raportowaniu, możliwy jest poprzez dostęp do systemu KDPW_TR, który posiadają wyłącznie Uczestnicy Repozytorium. Informacje dotyczące warunków uczestnictwa w repozytorium transakcji prowadzonego przez KDPW znajdują się w serwisie internetowym:

<http://www.kdpw.pl/pl/Repozytorium%20transakcji%20wersa%20EMIR/Strony/Przyst%c4%85pienie-do-Repozytorium.aspx>.

Na pisemny wniosek Uczestnika Rozliczającego, KDPW_CCP składa oświadczenie o wykonaniu, zgodnie z właściwymi przepisami prawa, obowiązku przekazania raportów o transakcjach do repozytorium transakcji w zakresie dotyczącym danych transakcji, objętych delegowaniem raportowania.

Jednocześnie KDPW_CCP może udostępniać Uczestnikom Rozliczającym raporty przekazywane do repozytorium transakcji, dotyczące transakcji zgłoszonych w ramach usługi delegowania raportowania.

7. Raportowanie wyceny i zabezpieczeń

Obowiązek zgłaszania dotyczy zarówno informacji o transakcjach pochodnych, jak i o wycenie instrumentów pochodnych i zabezpieczeniach złożonych odpowiednio w KDPW_CCP i u Uczestników Rozliczających oraz – w przypadku, gdy jest to praktykowane, u podmiotów zawierających transakcje pochodne na zlecenie Klientów Uczestników Rozliczających.

Zgłaszanie *wyceny* wprowadzane jest przez KDPW_CCP na klasę instrumentu notowanego na GPW (zbiorczo na ISIN). Wycena instrumentów pochodnych OTC przekazywana jest odrębnie do każdej zgłoszonej transakcji. Informacje te przekazywane są przez KDPW_CCP do repozytorium KDPW_TR od dnia RSD.

Zgłaszanie przez KDPW_CCP *zabezpieczeń złożonych przez Uczestnika Rozliczającego* na kontach zabezpieczeń jest równoznaczne z podaniem wartości sumy zabezpieczeń znajdujących się na wszystkich kontach. Informacje te są przekazywane przez KDPW_CCP do repozytorium KDPW_TR od dnia 'Report Submitting Day' (RSD).

KDPW_CCP rozpoczął zgłaszanie *zabezpieczeń klientów* 180 dni od dnia RSD, czyli od 11 sierpnia 2014 r. Raportowanie za pośrednictwem KDPW_CCP informacji o zabezpieczeniach złożonych odpowiednio u Uczestników Rozliczających oraz u podmiotów zawierających transakcje pochodne na zlecenie Klientów Uczestników Rozliczających jest przeprowadzane na podstawie dostarczonych do KDPW_CCP komunikatów XML, których format i struktura zostały udostępnione w zakładce <http://www.kdpwccp.pl/pl/raportowanie%20do%20repozytorium/Strony/Raportowanie-wyceny-i-zabezpieczen.aspx>. Konto zabezpieczeń użyte w raportach jest zbudowane w następujący sposób:

- dla ETD – prefiks 'ETD' + kod Uczestnika Rozliczającego
- dla ETD – prefiks 'ETD' + kod brokera
- dla ETD – prefiks 'ETD' + kod Uczestnika Rozliczającego + NKK (dla zabezpieczeń klientów)
- dla OTC – kod uczestnika + ogólny id konta zabezpieczeń (PB)

Proces raportowania zabezpieczeń złożonych przez Klientów u Uczestników Rozliczających (UR) jest następujący:

1. UR przekazuje do KDPW_CCP komunikat colr.ins.002.03, którego struktura jest dostępna na stronie internetowej w zakładce:
http://www.kdpwccp.pl/pl/Uczestnicy/Strony/Komunikaty_kdpw_stream.aspx.

Komunikat z wartością zabezpieczeń klientów jest przekazywany do RT dnia następnego (T+1), przy czym wszystkie komunikaty zawierające wartość zabezpieczeń klientów z dnia T, dostarczone do systemu kdpw_stream do godz. 7.30 w dniu T+1, zostaną przekazane w tym dniu do Repozytorium Transakcji KDPW_TR.

2. KDPW_CCP przeprowadza wyłącznie kontrolę zgodności przekazanego komunikatu ze schemą. W przypadku niezgodności komunikatu ze schemą, komunikat otrzymuje status przetwarzania informujący o niezgodności – 'admi.err.001.01', ze wskazaniem miejsca błędu.
3. W przypadku zgodności, komunikat otrzymuje status informujący o przyjęciu przez KDPW_CCP do dalszego przetwarzania – (PACK). W odpowiedzi KDPW_CCP przekazuje do UR informację statusową (colr.sts.002.01).
4. W następnej kolejności, KDPW_CCP przygotowuje dwa komunikaty do RT na parę kontrahentów (UR-CL i CL-UR) i wysyła do RT. Po otrzymaniu informacji zwrotnej z RT, KDPW_CCP przekazuje do UR komunikat zawierający informację statusową (colr.sts.002.01), adekwatną do informacji przekazanej przez RT (COMP lub REJT). Status COMP oznacza, że komunikat został przyjęty i przetworzony poprawnie przez RT. Natomiast status REJT oznacza odrzucenie komunikatu przez RT ze wskazaniem kodu błędu wraz z opisem powodu odrzucenia przez RT.

8. Zgłaszanie transakcji historycznych

Pierwotnie ustalono, że zgłaszanie transakcji historycznych nastąpi w terminie 3 lat od dnia 'Report Submitting Day' RSD, jednak termin został wydłużony do 5 lat. Następnie Regulacje Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 20 maja 2019 r. ustanowiły o usunięciu z art. 9 Rozporządzenia EMIR obowiązku zgłaszania transakcji historycznych do repozytoriów transakcji.

9. Terminacja instrumentów pochodnych w dniu ich wygasania

W dniu następującym po dniu wygasania instrumentów pochodnych (Maturity date), w repozytorium transakcji KDPW_TR automatycznie terminowane są wszystkie raporty na wygasających kontraktach. KDPW_CCP odbiera komunikaty i odpowiednio przetwarza je w swoim systemie w celu zachowania prawidłowego stanu bazy stanowiącej podstawę dokonywania zgłoszeń.

10. Komunikat o zgłoszeniu transakcji - brak informacji o kodzie LEI

KDPW_CCP udostępnia Uczestnikom Rozliczającym komunikat informujący o niezareportowaniu transakcji do RT dla wskazanych kont ze względu na brak aktywnego kodu LEI podmiotu zobowiązanego do raportowania. Komunikat secl.str.001.01 wysyłany jest codziennie po zakończeniu raportowania danego dnia. Po uzupełnieniu danych raporty wysyłane są ponownie do KDPW_TR.