

KDPW_CCP – zasady wymiany danych z wykorzystaniem standardu FpML oraz standardu komunikatów dla instrumentów pochodnych OTC

DATA AKTUALIZACJI	WERSJA	OPIS
12.2020	1.0	Powstanie dokumentu
03.2022	1.1	Aktualizacja dokumentu w zakresie FpML oraz dodanie standardu xml
09.2024	1.2	Zmiana standardu FpML z 5.11 na 5.12

SPIS TREŚCI:

WSTĘP.....	4
FPML.....	4
PODSTAWOWE ZAŁOŻENIA	4
ZAKRES.....	4
WERSJA STANDARDU	4
ZGODNOŚĆ ZE STANDARDEM BAZOWYM	4
GŁÓWNY ELEMENT KOMUNIKATU (ROOT ELEMENT)	5
NAGŁÓWEK BIZNESOWY (HEADER)	5
POWIĄZANIA POMIĘDZY KOMUNIKATAMI (REFERENCJE)	6
PODSTAWOWE BLOKI KOMUNIKATU	6
PRODUKT (PRODUCT)	6
1. Kontrakt forward na stopę procentową (Forward Rate Agreements)	7
2. Kontrakt swap stopy procentowej (IRS, OIS, basis swap)	8
INSTYTUCJA I KONTO (PARTY, ACCOUNT).....	8
IDENTYFIKATORY TRANSAKCJI W NAGŁÓWKU TRANSAKCJI	10
PROCESY BIZNESOWE	12
PODSTAWOWY SCHEMAT PRZYJMOWANIA NOWEJ TRANSAKCJI	12
POTWIERDZENIE ROZLICZENIA (CLEARINGCONFIRMED)	13
STATUS TRANSAKCJI (CLEARINGSTATUS).....	14
ODRZUCENIE ROZLICZENIA (CLEARINGREFUSED)	15
POZIOM WYKORZYSTANIA LIMITU ZABEZPIECZEŃ	16
ZAPYTANIE O POZIOM LIMITU ZABEZPIECZEŃ.....	18
ZAPYTANIE O TRANSAKCJĘ HIPOTETYCZNAŁ (WHAT IF)	20
KOMPRESJA CAŁKOWITA LUB CZĘŚCIOWA.....	22
STATUS UCZESTNIKA ROZLICZAJĄCEGO.....	24

AUKCJA	25
TERMINACJA NA ŻĄDANIE	28
PORTING TRANSAKCJI	29
ODRZUCENIE KOMUNIKATU (MESSAGEREJECTED).....	31
RAPORTY	31
POZOSTAŁE KOMUNIKATY XML OBECNIE FUNKCJONUJĄCE.....	33
ZAŁĄCZNIK 1 – LISTA KOMUNIKATÓW FPML WYKORZYSTYWANYCH W KDPW_CCP	34
ZAŁĄCZNIK 2 - SCHEMATY KODOWE (CODING SCHEMES).....	36
ZAŁĄCZNIK 3 – LISTA KOMUNIKATÓW XML WYKORZYSTYWANYCH W KDPW_CCP	37

WSTĘP

Dokument opisuje zasady wymiany danych w systemie KDPW_CCP z wykorzystaniem standardu FpML. Opisane komunikaty wykorzystywane są w procesie rozliczeń instrumentów pochodnych OTC prowadzonych przez KDPW_CCP. W odrębnym dokumencie będącym uzupełnieniem niniejszego materiału zostanie zamieszczona lista komunikatów, które przestaną być obsługiwane.

W dokumencie przedstawiono podstawowe scenariusze wymiany komunikatów. Opisano wykorzystywane struktury danych wraz z przykładami oraz omówiono typowe bloki składowe, wykorzystywane w podobny sposób w wielu typach komunikatów.

Dokument ten powstał w ramach projektu rozwoju systemu rozliczeń kdpw_stream dla transakcji OTC prowadzonego przez KDPW_CCP.

FpML

FpML (Financial products Markup Language) to otwarty standard elektronicznego przetwarzania danych i obsługi procesów związanych z instrumentami pochodnymi OTC oparty o XML. Standard powstał, oraz jest rozwijany pod patronatem ISDA (International Swaps and Derivatives Association).

Dokumentacja standardu, w tym struktury komunikatów, dostępne są na stronie: <https://www.fpml.org>

PODSTAWOWE ZAŁOŻENIA**Zakres**

Zakłada się, że komunikaty FpML będą wykorzystywane w systemie KDPW_CCP głównie do przekazywania statusów transakcji OTC przyjętych do rozliczenia, w tym informacji o potwierdzeniu przyjęcia, kolejkowania lub odrzucenia transakcji oraz do przekazywania informacji o wymaganych zabezpieczeniach.

Nie przewiduje się wykorzystania standardu FpML w procesach takich jak: zarządzanie kontami, zarządzanie uczestnictwem, opłaty, rozrachunki pieniężne, obsługa funduszy zabezpieczających w szczególności ze względu na brak wypracowanych przez Izby standardów.

Niniejszy dokument opisuje wymianę danych pomiędzy KDPW_CCP a uczestnikami rozliczającymi z obszaru OTC. Dokument nie zawiera informacji na temat wymiany danych z platformami konfirmacji ani bezpośrednio pomiędzy kontrahentami.

Wersja standardu

W pracach projektowych zostanie wykorzystany standard FpML w wersji **5.12** opublikowany w grudniu 2019 r.

<https://www.fpml.org/spec/fpml-5-12-4-rec-1/>

Zgodność ze standardem bazowym

Komunikaty wymieniane pomiędzy KDPW_CCP a uczestnikami rozliczającymi muszą być zgodne z bazowym standardem FpML.

Dodatkowo komunikaty muszą być zgodne z regułami biznesowymi, przedstawionymi w niniejszym dokumencie. KDPW_CCP określi długość niektórych pól stosowanych w komunikatach FpML dla wskazanych wartości, lista zaprezentowana będzie w odrębnym dokumencie uzupełniającym materiał.

Główny element komunikatu (root element)

Nazwa głównego elementu komunikatu FpML określa jego funkcję. Atrybuty elementu głównego definiują stosowane przestrzenie nazw (namespaces) oraz opcjonalnie wskazanie miejsca w którym znajduje się schemat komunikatu (xsd schema).

Dodatkowym atrybutem elementu głównego jest wskazanie stosowanej wersji FpML (fpmlVersion).

Przykładowa postać głównego elementu komunikatu FpML została przedstawiona poniżej:

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<clearingConfirmed xmlns="http://www.fpml.org/FpML-5/confirmation"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
fpmlVersion="5-12"
xsi:schemaLocation="http://www.fpml.org/FpML-5/confirmation confirmation-merged-schema-5-11/confirmation/fpml-main-5-12.xsd
http://www.w3.org/2000/09/xmldsig# confirmation-merged-schema-5-12/confirmation/xmldsig-core-schema.xsd">
  <header>
...
  </header>
  <trade>
...
</clearingConfirmed>
```

Nagłówek biznesowy (header)

Komunikaty FpML posiadają sekcję nagłówkową definiującą nadawcę i odbiorcę komunikatu. Nagłówek zawiera również identyfikator komunikatu oraz datę jego utworzenia.

Przykładowy nagłówek komunikatu wysłanego przez KDPW_CCP będzie miał następującą postać:

```
<header>
  <messageId
    messageIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/message-id">
    MSG1
  </messageId>

  <sentBy messageIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id">
    0010
  </sentBy>

  <sendTo messageIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id">
    09AA
  </sendTo>
  <creationTimestamp>2021-01-04T08:57:00</creationTimestamp>
</header>
```

Powiązania pomiędzy komunikatami (referencje)

Każdy komunikat oznaczony jest identyfikatorem utworzonym przez nadawcę w polu *messageId*.

W komunikacie będącym odpowiedzią należy przekazać w polu *inReplyTo* identyfikator *messageId* z otrzymanego komunikatu.

Przykład:

Instytucja A przesyła do instytucji B komunikat oznaczony następującymi identyfikatorami :

```
<messageId messageIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/message-id">  
    MSG0001  
</messageId>
```

Komunikat przesłany w odpowiedzi przez instytucję B do instytucji A będzie zawierał następujące identyfikatory:

```
<messageId messageIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/message-id">  
    BMSG04321  
</messageId>  
<inReplyTo messageIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/message-id">  
    MSG0001  
</inReplyTo>
```

PODSTAWOWE BLOKI KOMUNIKATU**Produkt (product)**

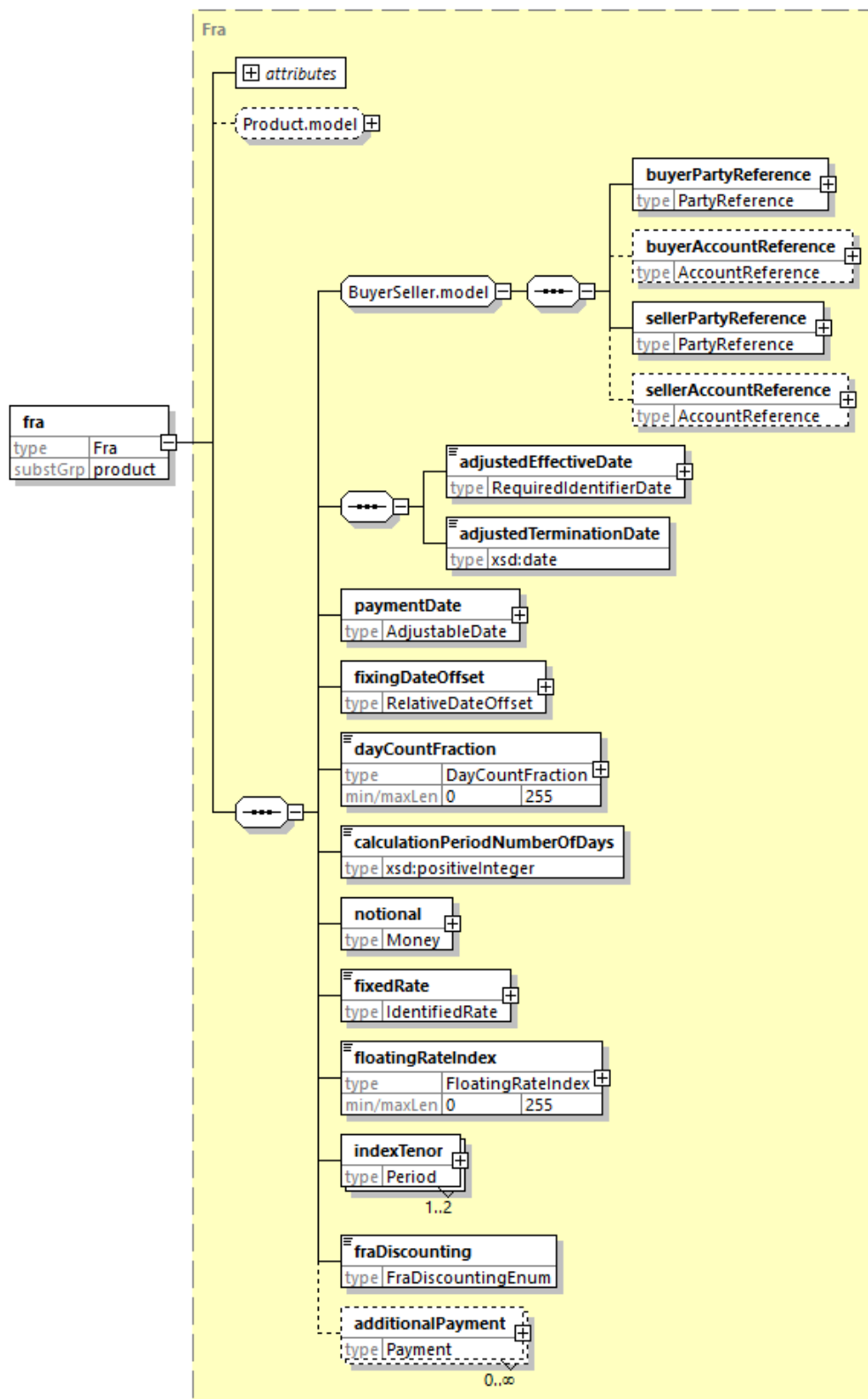
KDPW_CCP obsługuje następujące klasy instrumentów pochodnych OTC:

1. Forward na stopę procentową (Forward Rate Agreements),
2. Swap stopy procentowej (Interest Rate Swaps), Overnight Index Swaps, Basis Swaps.

Charakterystyka powyższych instrumentów będzie przekazywana za pomocą struktur danych opisanych w kolejnych podrozdziałach.

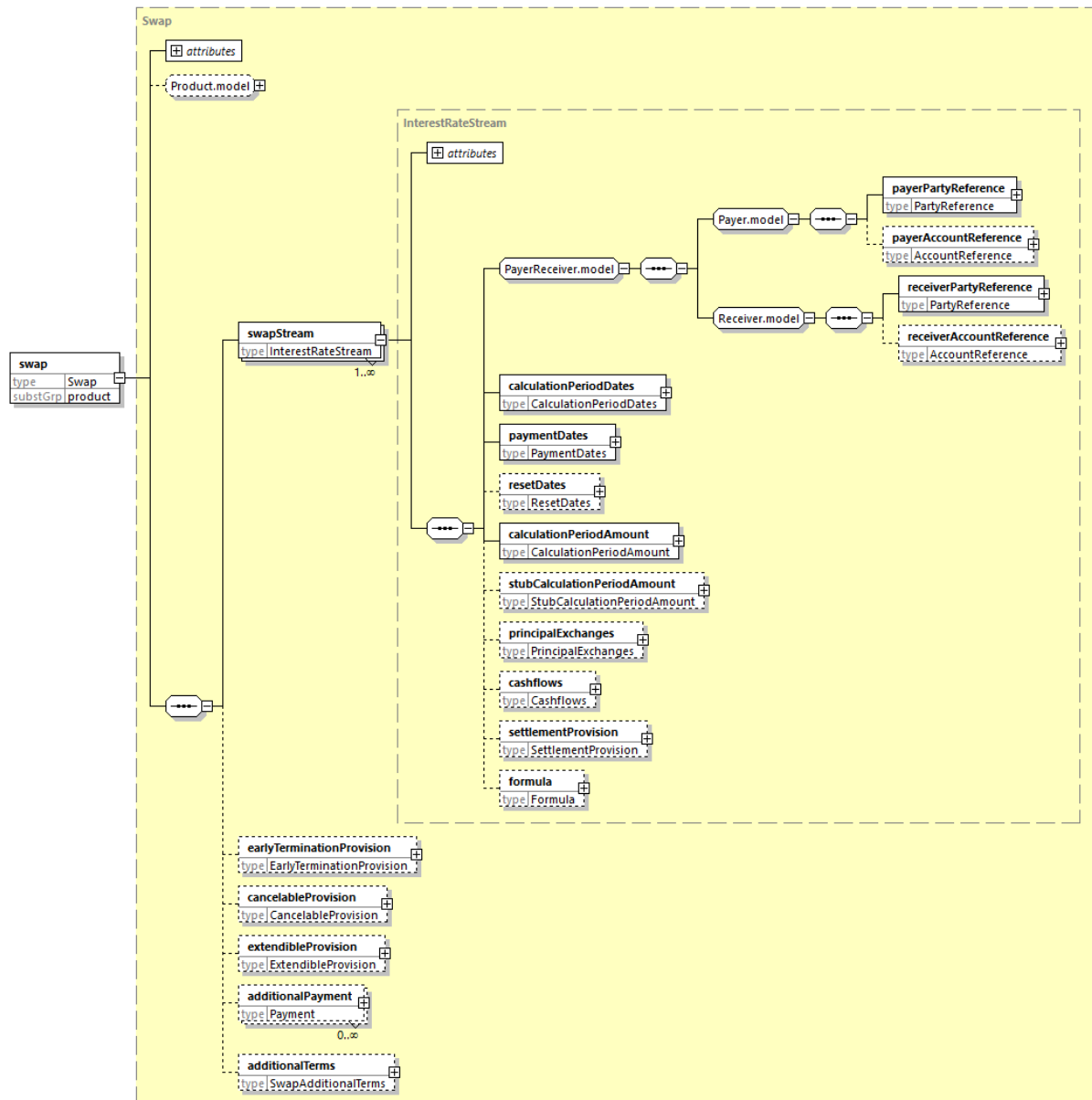
1. Kontrakt forward na stopę procentową (Forward Rate Agreements)

Struktura danych opisująca kontrakt FRA ma następującą postać:



2. Kontrakt swap stopy procentowej (IRS, OIS, basis swap)

Kontrakty swap opisywane są w standardzie FpML następującą strukturą:



Instytucja i konto (party, account)

W komunikatach FpML identyfikatory instytucji oraz kont definiowane są w jednym wyróżnionym miejscu w końcowej części treści komunikatu. W pozostałych częściach komunikatu informacje o instytucjach i kontach przekazywane są poprzez referencję do zdefiniowanych identyfikatorów.

Instytucje definiowane są w komunikatach FpML poprzez następującą strukturę:

- **id** – oznaczenie (referencja) stosowane w innych częściach komunikatu
- **partyIdScheme** – typ identyfikatora w formacie URI
np. 'http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id'
- **partyId** - wartość identyfikatora – np. czteroznakowy kod uczestnika rozliczającego nadany przez KDPW_CCP.

W komunikatach przekazywanych przez KDPW_CCP występują następujące rodzaje instytucji:

- **partyA** – kontrahent/ kontrpartner
- **KDPW_CCP** – KDPW CCP S.A.
- **Markit** – platforma confirmacji MarkitWire, prowadzona przez IHS Markit

Definicja instytucji KDPW_CCP, której oznaczenie kodowe to '0010':

```
<party id="KDPW_CCP">
  <partyId partyIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id">
    0010
  </partyId>
</party>
```

Konta definiowane są w komunikatach FpML poprzez następującą strukturę:

- **id** – oznaczenie (referencja) stosowane w innych częściach komunikatu
- **accountIdScheme** – typ identyfikatora w formacie URI
np. 'http://www.kdpwccp.pl/otc/account-id-PA'
- **accountId** - wartość identyfikatora konta
- **accountBeneficiary** – instytucja, do której należy konto

Przykładowa definicja konta instytucji, którego oznaczenie kodowe dla konta 'PA-09AA-1001' to:

```
<account id="partyAAccount">
  <accountId accountIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/account-id-PA">
    PA-09AA-1001
  </accountId>
  <accountBeneficiary href="partyA"/>
</account>
```

Przykładowa definicja dla konta 'PB-09AA-1040000666666':

```
<account id="partyAAccount">
  <accountId accountIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/account-id-PB">
    PB-09AA-1040000666666
  </accountId>
  <accountBeneficiary href="partyA"/>
</account>
```

W typowym komunikacie przekazywanym przez KDPW_CCP zdefiniowane będą następujące instytucje i powiązane z nimi konta. Jako kontrpartner w komunikatach udostępnianych przez KDPW_CCP wskazywany będzie KDPW_CCP:

<code><party id="partyA"></code>	Kontrahent
<code> <partyId partyIdScheme= "http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id"> 09AA </partyId></code>	Kontrahent - Identyfikator nadany przez KDPW_CCP
<code> <partyId partyIdScheme= "http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id-markit"> ABCDEFGH </partyId></code>	Kontrahent - Identyfikator MarkitBIC
<code></party></code>	
<code><party id="KDPW_CCP"></code>	KDPW_CCP
<code> <partyId partyIdScheme= "http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id"> 0010 </partyId></code>	Identyfikator KDPW_CCP
<code></party></code>	
<code><party id="Markit"></code>	
<code> <partyId partyIdScheme= "http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id-markit"> Markit </partyId></code>	Identyfikator MarkitWire
<code></party></code>	
<code><account id="partyAAccount"></code>	Konto kontrahenta
<code> <accountId accountIdScheme= "http://www.kdpwccp.pl/otc/account-id-PA"> PA-09AA-1001 </accountId></code>	Konto PA
<code> <accountId accountIdScheme= "http://www.kdpwccp.pl/otc/account-id-PB"> PB-09AA-1040000666666 </accountId></code>	Konto PB
<code> <accountBeneficiary href="partyA"/></code>	
<code></account></code>	

Identyfikatory transakcji w nagłówku transakcji

Blok danych opisujący transakcję składa się z nagłówka transakcji i danych produktu.

Nagłówek transakcji *tradeHeader* zawiera identyfikatory przypisane przez strony transakcji, platformę konfirmacyjną oraz izbę rozliczeniową.

Identyfikatory transakcji przekazywane w sekcji *tradeHeader* komunikatów FpML mają następującą strukturę:

- **partyReference** – id instytucji, której dotyczy identyfikator lub która jest wystawcą identyfikatora
- **tradeIdScheme** – typ identyfikatora w formacie URI
np. 'http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-id'
- **tradeId** – wartość identyfikatora

Typowy nagłówek transakcji w komunikatach przekazywanych przez KDPW_CCP może zawierać następujące oznaczenia:

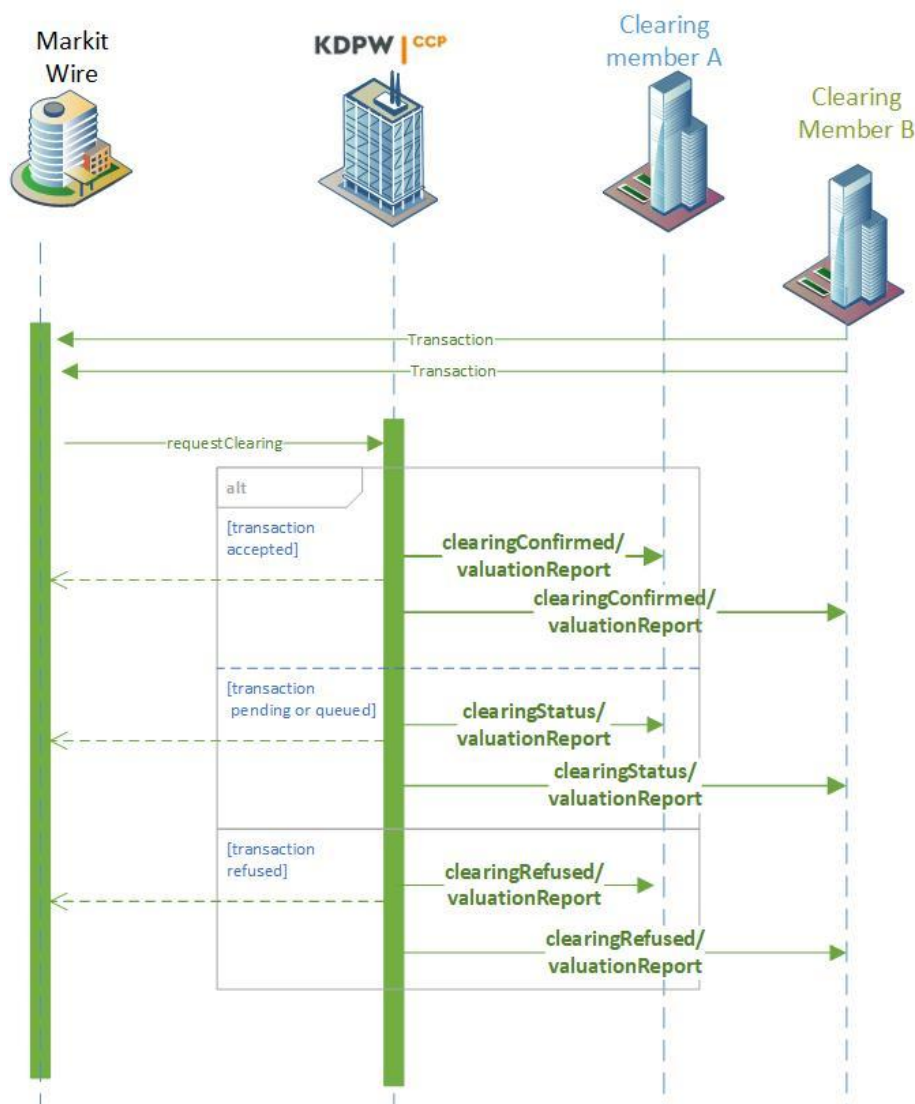
<tradeHeader>	
<partyTradeIdentifier>	
<partyReference href="Markit"/>	Identyfikatory MarkitWire
<tradeId tradeIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-id-markit"> TRAD-ABC123456 </tradeId>	Identyfikator transakcji OTC nadany na platformie Markit, wspólny dla obu stron (External DealID)
<tradeId tradeIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/instruction-id-markit"> INS-ABC123456 </tradeId>	Identyfikator wewnętrzny transakcji nadany na platformie Markit przez uczestnika
<tradeId tradeIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/betacleared-id-markit"> BC-ABC123456 </tradeId>	Identyfikator BetaCleared nadany na platformie Markit
</partyTradeIdentifier>	
<partyTradeIdentifier>	
<partyReference href="KDPW_CCP"/>	Identyfikatory nadane przez KDPW_CCP
<tradeId tradeIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-id "> CCP-TR-54321 </tradeId>	Identyfikator transakcji nadany przez KDPW_CCP (DealID)
<tradeId tradeIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/instruction-id "> CCP-INS-654321 </tradeId>	Identyfikator instrukcji nadany przez KDPW_CCP (TradeID)
</partyTradeIdentifier>	
<partyTradeIdentifier>	
<partyReference href="partyA"/>	Identyfikatory nadane przez uczestnika
<tradeId tradeIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-id "> TR-54321 </tradeId>	Identyfikator transakcji nadany przez uczestnika
</partyTradeIdentifier>	
<partyTradeIdentifier>	
<partyReference href="KDPW_CCP"/>	
<tradeId tradeIdScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-offered-id">278018429</tradeId>	Identyfikatory nadane przez KDPW_CCP przy procesie aukcji
</partyTradeIdentifier>	
<partyTradeInformation>	
<partyReference href="KDPW_CCP"/>	
<category categoryScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/auction-id">Auction 1</category>	Identyfikatory nadane przez KDPW_CCP przy procesie aukcji

<code><category categoryScheme="http://www.kdpwccp.pl/otc/segment- id">Segment 1</category></code>	Identyfikatory nadane przez KDPW_CCP przy procesie aukcji
<code></partyTradeInformation></code>	
<code><tradeDate>2021-12-03</tradeDate></code>	Data transakcji
<code><clearedDate>2021-12-07</clearedDate></code>	Data nowacji (pole nie pojawi się przy odrzuconej lub oczekującej transakcji)
<code></tradeHeader></code>	

PROCESY BIZNESOWE

Podstawowy schemat przyjmowania nowej transakcji

Poniżej przedstawiono podstawowy schemat wymiany danych dla transakcji potwierdzanych na platformie confirmacji (MarkitWire):



Po otrzymaniu transakcji KDPW_CCP przekazuje uczestnikom rozliczającym jeden z komunikatów:

- clearingConfirmed
- clearingStatus
- clearingRefused

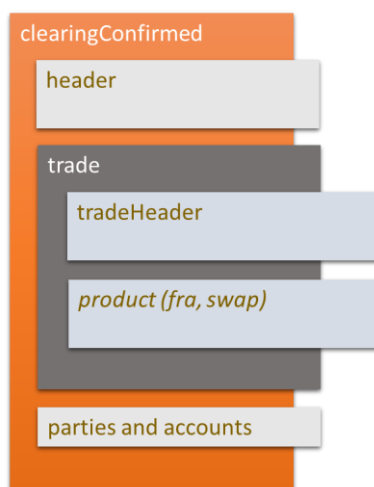
Komunikat clearingRefused nie zostanie przekazany uczestnikom w przypadku, gdy KDPW_CCP otrzyma błędny Markit BIC, informacja zostanie przekazana w komunikacie zwrotnym na MarkitWire.

Dodatkowo uczestnikom przekazywany jest komunikat valuationReport zawierający dane dotyczące wykorzystania limitu zabezpieczeń.

Powyższe komunikaty zostały opisane w dalszej części dokumentu.

Potwierdzenie rozliczenia (clearingConfirmed)

Komunikat *clearingConfirmed* jest przesyłany uczestnikom rozliczającym w przypadku otrzymania przez KDPW_CCP poprawnej transakcji z platformy confirmacji, transakcji z aukcji, transakcji po portingu lub kompresji spełniającej wymogi kontroli formalnej i merytorycznej. Składa się on z następujących elementów:



Przykład komunikatu potwierdzenia rozliczenia:

Opis	Typ komunikatu	Link
Przykład komunikatu potwierdzenia rozliczenia	clearingConfirmed	 KDPW_CCP_clearingC onfirmed_01_trade_M'

Status transakcji (clearingStatus)

Komunikat *clearingStatus* jest przesyłany uczestnikom rozliczającym w przypadku otrzymania przez KDPW_CCP poprawnej transakcji z platformy confirmacji, która oczekuje na przyjęcie do rozliczeń, po odpowiedzi na zapytanie *what if*, po wykonaniu portingu transakcji oraz w procesie aukcji:



W porównaniu do potwierdzenia rozliczenia komunikat statusowy posiada dodatkowe pole *clearingStatusValue*, które może przyjąć jedną z następujących wartości:

- QUEUED – Transakcja przestana po zamknięciu systemu.
- PENDING – Transakcja która nie przeszła kontroli limitu i oczekuje na dalsze przetwarzanie.
- ACCEPTED_WHATIF – Hipotetyczna transakcja przeszła poprawnie kontrolę limitu.
- PENDING_WHATIF – Hipotetyczna transakcja nie przeszła kontroli limitu.
- PORTED – Transakcja przeniesiona na konto zgodnie ze zleceniem.
- AUCTION – Transakcja pochodząca z aukcji.

Przykład komunikatu statusu rozliczenia:

Opis	Typ komunikatu	Link
Przykład komunikatu statusu rozliczenia	clearingStatus	 KDPW_CCP_clearingStatus_01_trade_MW.xml

Odrzucenie rozliczenia (clearingRefused)

Komunikat *clearingRefused* jest przesyłany uczestnikom rozliczającym w przypadku otrzymania przez KDPW_CCP z platformy confirmacji transakcji, która nie może zostać rozliczona lub w odpowiedzi na zapytanie *what if*. Składa się on z następujących bloków:



W porównaniu do potwierdzenia rozliczenia komunikat statusowy posiada dodatkowe pole *reason*, w którym zostanie opisana przyczyna odrzucenia transakcji. Kody błędów i komunikaty zwrotne wysyłane w przypadku ich wystąpienia zostaną zdefiniowane w odrębnym dokumencie.

Przykład komunikatu odrzucenia rozliczenia:

Opis	Typ komunikatu	Link
Przykład komunikatu odrzucenia rozliczenia	clearingRefused	 KDPW_CCP_clearingRefused_clearing.xml

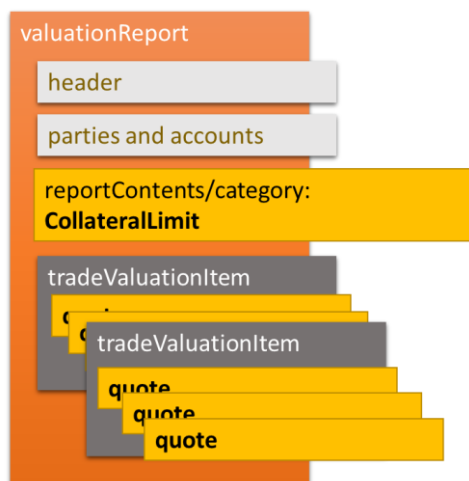
Poziom wykorzystania limitu zabezpieczeń

KDPW_CCP przekazuje uczestnikom informacje o poziomie wykorzystania limitu zabezpieczeń w postaci komunikatu *valuationReport* w funkcji *CollateralLimit*.

Komunikat ten jest przekazywany w następujących przypadkach:

- automatycznie po przyjęciu transakcji - *CollateralLimitPostTrade*;
- automatycznie do transakcji oczekującej na przyjęcie do rozliczeń - *CollateralLimitTradeState*;
- w odpowiedzi na pytanie uczestnika o poziom wykorzystania limitu - *CollateralLimitOnRequest*;
- w odpowiedzi na pytanie uczestnika o wpływ transakcji hipotetycznej - *CollateralLimitWhatIf*;
- w odpowiedzi na wykonany porting *CollateralLimit*;
- wezwania do uzupełnienia zabezpieczeń - *MarginCall*.

Blokowy schemat raportu:



Funkcja raportu *CollateralLimit* przekazywana jest w polu: *reportContents/category*.

W zależności od kontekstu, raport zawiera identyfikator transakcji i identyfikator konta zabezpieczeń, którego dotyczą przekazywane dane.

Poszczególne wartości przekazywane są w powtarzalnych sekcjach *quote*.

Przykładowo wartość depozytu właściwego będzie przekazana za pomocą następującej sekwencji:

```

<quote>
  <value>100</value>
  <measureType>InitialMargin</measureType>
  <currency>PLN</currency>
</quote>
  
```

Poniżej przedstawiono pełną listę wartości wykorzystywanych przez KDPW_CCP w polu *measureType* dla raportu *valuationReport* w funkcji *CollateralPostTrade*. W zależności od kontekstu przekazywane mogą być tylko wybrane elementy z poniższej listy. Poniższe dane przekazywane są na poziomie uczestnika rozliczającego i kont zabezpieczeń PB.

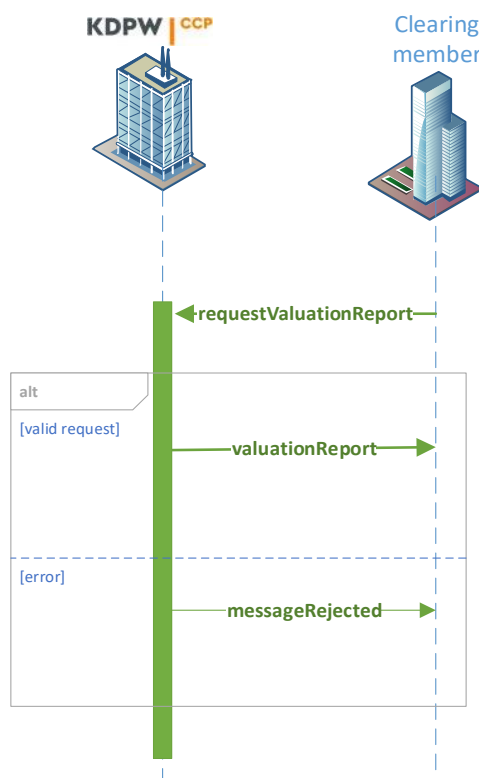
Oznaczenie	Uwagi
Collateral	
CollateralLimitSurplus	Wartość <0 oznacza konieczność uzupełnienia depozytu
InitialMarginRequirementBefore	
InitialMarginRequirement	
InitialMargin	
AddOnMargin	
VariationMargin	
SettlementAdjustment	
IndividualLimit	Jeżeli ustanowiony jest limit na koncie PB
IndividualLimitSurplus	Jeżeli ustanowiony jest limit na koncie PB

Przykładowa postać raportu *valuationReport*:

Opis	Typ komunikatu	Link
Raport wykorzystania limitów	valuationReport	 KDPW_CCP_valuation Report_CollateralLimit

Zapytanie o poziom limitu zabezpieczeń

Uczestnik może zadać pytanie o poziom wykorzystania limitu zabezpieczającego za pomocą komunikatu *requestValuationReport*. W tym komunikacie wymagane jest wskazanie konta dla którego wysyłane jest zapytanie. W przypadku przekazania poprawnego komunikatu, KDPW_CCP prześle uczestnikowi raport w postaci komunikatu *valuationReport*. W przekazanym raporcie uczestnik znajdzie informacje dotyczące aktualnego wykorzystania limitów oraz dostępnego poziomu. W przypadku błędnego zapytania w odpowiedzi udostępniony zostanie komunikat *MessageRejected*.



Blokowy schemat zapytania o wartości limitów:

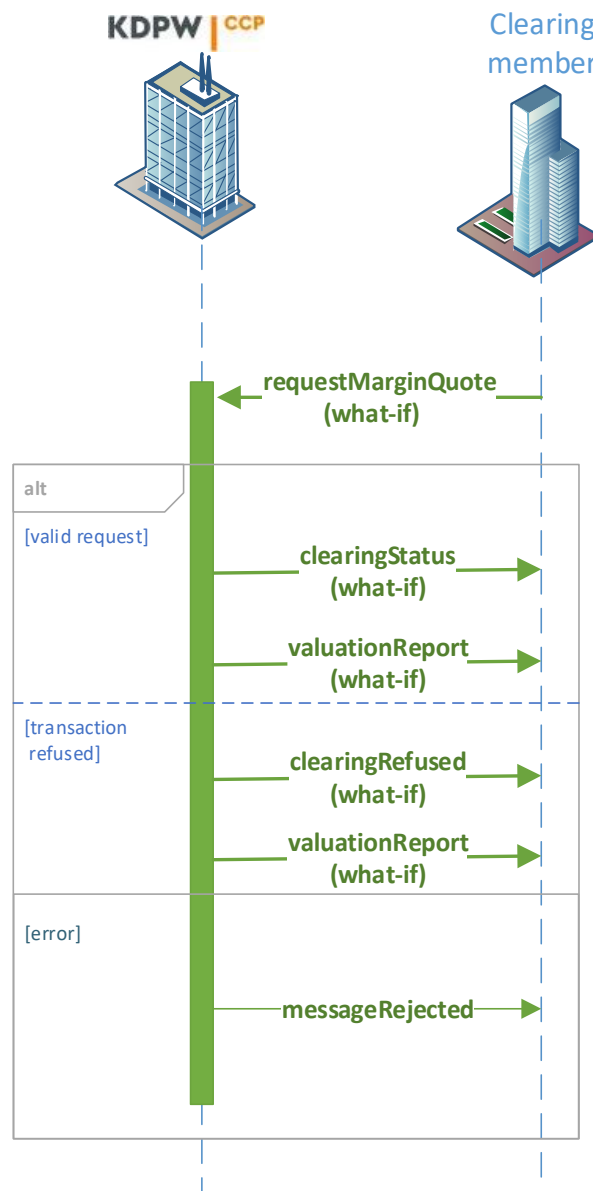


Przykładowa postać raportu na żądanie:

<i>Opis</i>	<i>Typ komunikatu</i>	<i>Link</i>
Zapytanie o wykorzystanie limitów	requestValuationReport	 KDPW_CCP_requestValuationReport_01.xml
Raport wykorzystania limitów	valuationReport	 KDPW_CCP_valuationReport_CollateralLimit

Zapytanie o transakcję hipotetyczną (*what if*)

Uczestnik rozliczający może zapytać KDPW_CCP o wpływ hipotetycznej transakcji na poziom wymaganych zabezpieczeń i wykorzystanie limitu zabezpieczeń. Uczestnik może przysłać wiele transakcji w jednym komunikacie *requestMarginQuote*, jednak należy zapewnić unikalność identyfikatorów używanych w strukturze komunikatu. Transakcje mogą dotyczyć jednego konta rozliczeniowego PA. W tym celu wykorzystywany jest komunikat *requestMarginQuote*. W odpowiedzi na otrzymane zapytanie KDPW_CCP przekazuje parę komunikatów: *clearingStatus/clearingRefused* oraz *valuationReport* lub komunikat *messageRejected* w przypadku odrzucenia zapytania.



Komunikat *requestMarginQuote* ma następującą postać blokową:



Komunikat *clearingStatus* przyjmie jeden z dedykowanych dla zapytania *what if* kodów statusu:

- ACCEPTED_WHATIF – hipotetyczna transakcja przeszła poprawnie kontrolę limitu
- PENDING_WHATIF – hipotetyczna transakcja nie przeszła kontroli limitu

Przykładowe komunikaty:

Opis	Typ komunikatu	Link
Przykład zapytania <i>what if</i>	requestMarginQuote	 KDPW_CCP_requestMarginQuote_What_If_FI
Przykład odpowiedzi na zapytanie <i>what if</i>	clearingStatus	 KDPW_CCP_clearingStatus_Accepted_01_Wh
Odrzucenie zapytania <i>what if</i>	clearingRefused	 KDPW_CCP_clearingRefused_whatif.xml
Poziom zabezpieczeń	valuationReport	 KDPW_CCP_valuationReport_What_If_01 wie

KOMPRESJA CAŁKOWITA LUB CZĘŚCIOWA TYPU „NETTING”

W celu wykonania kompresji na poziomie konta rozliczeniowego należy zaznaczyć właściwą flagę (automatyczna kompresja). Oznaczenie tej flagi jako „Y” spowoduje włączenie opcji kompresji. Zmiany przy koncie będą wykonywane z interfejsu w GUI zewnętrznym.

W ramach procesu kompresji tworzony jest zbiór transakcji zakwalifikowanych do kompresji na poziomie konta rozliczeniowego w obrębie uczestnika rozliczającego oraz dla danego typu transakcji. Selekcja transakcji OTC polega na znalezieniu przynajmniej dwóch instrukcji spełniających określone przez KDPW CCP warunki. Wynikiem kompresji będzie całkowita - “FullNetting” lub częściowa terminacja - “PartialNetting”. Wówczas uczestnik otrzyma od KDPW_CCP komunikaty *clearingConfirmed*.

Zmiana wartości nominalnej oraz pozostała wartość nominalna przekazywana jest w polach *changeInNotionalAmount* i *outstandingNotionalAmount*. W przypadku terminacji całkowitej (“FullNetting”) pole *outstandingNotionalAmount* przyjmie wartość 0.

Elementem odróżniającym powiadomienie o kompresji od przyjęcia nowej transakcji jest pole *compressionActivity* przyjmujące wartość: “FullNetting”, “PartialNetting”. Dodatkowo komunikat zawiera sekcję *termination* zawierającą identyfikatory terminowanych lub nowych transakcji.



Instrumentami, które podlegają kompresji będą: IRS, OIS, BS oraz FRA. Weryfikacja instrukcji odbywa się wyłącznie w obrębie danego konta rozliczeniowego u uczestnika rozliczającego - pod warunkiem, że flaga kompresji na koncie ma wartość ‘Y’.

Przykład komunikatu *clearingConfirmed* wykorzystywanego przy kompresji transakcji:

Opis	Typ komunikatu	Link
Kompresja transakcji – częściowa	clearingConfirmed	 KDPW_CCP_clearingC onfirmed_compressio
Kompresja transakcji - pełna	clearingConfirmed	 KDPW_CCP_clearingC onfirmed_compressio

KOMPRESJA CAŁKOWITA LUB CZĘŚCIOWA TYPU „BLENDING”

W celu wykonania kompresji na poziomie konta rozliczeniowego należy zaznaczyć właściwą flagę dla tego typu kompresji. Flaga ta oznaczona jest jako „B” i spowoduje automatyczne włączenie opcji kompresji. Zmiany przy koncie będą wykonywane z interfejsu w GUI zewnętrznym analogicznie do rozwiązywania powyżej.

W ramach procesu kompresji tworzony jest zbiór transakcji zakwalifikowanych do kompresji na poziomie konta rozliczeniowego w obrębie uczestnika rozliczającego oraz dla danego typu transakcji. Selekcja transakcji OTC polega na znalezieniu przynajmniej dwóch instrukcji spełniających określone przez KDPW CCP warunki (różnicą względem „nettingu” będzie dopuszczenie kompresji o różnych stopach stałych). Wynikiem kompresji będzie całkowita terminacja - “FullBlending” lub całkowita terminacja i powstanie nowej lub nowych transakcji zastępującej przepływy wygaszanych - “Blending”. Wówczas uczestnik otrzyma od KDPW_CCP komunikaty *clearingConfirmed.02* – dla wszystkich sterminowanych oraz *clearingConfirmed.01* zawierający informacje o nowej transakcji

Do kompresji dopuszczone są transakcje o nieregularnej pierwszej płatności o ile są one identyczne lub data kompresji jest po zakończeniu pierwszego okresu rozliczeniowego. Kompresja może zostać przeprowadzona, jeśli płatności dodatkowe FEE zostały rozliczone. Możliwa jest kompresja transakcji z tym samym spreadem.

W polach *changeInNotionalAmount* i *outstandingNotionalAmount* w przypadku całkowitej (“FullBlending”) oraz częściowej (“Blending”) pole *outstandingNotionalAmount* przyjmie wartość 0. W przypadku kompresji częściowej w komunikacie *otcm.clr.cnf.02* znajdzie się sekcja

<replacementTradeld> zawierająca ID instrukcji przesyłanej w oddzielnym komunikacie *otcm.clr.cnf.01*

Elementem odróżniającym powiadomienie o kompresji od przyjęcia nowej transakcji jest pole *compressionActivity* przyjmujące wartość: “Blending”, “FullBlending”. Dodatkowo komunikat zawiera sekcję *termination* zawierającą identyfikatory terminowanych lub nowych transakcji.

Informacja o rezultatach kompresji zostanie wysłana do platformy confirmacyjnej MARKIT. To oznacza, że informacja o nowych transakcjach oraz sterminowanych znajdzie się również na tej platformie. W komunikacie będzie zawarta informacja o „betacleared-id-markit”

Instrumentami, które podlegają kompresji będą: IRS, OIS oraz FRA. Weryfikacja instrukcji odbywa się wyłącznie w obrębie danego konta rozliczeniowego u uczestnika rozliczającego - pod warunkiem, że flaga kompresji na koncie ma wartość 'B'.

Przykład komunikatu *clearingConfirmed* wykorzystywanego przy kompresji transakcji:

Opis	Typ komunikatu	Link
Kompresja transakcji – częściowa	clearingConfirmed	 otcm.clr.cnf.01  otcm.clr.cnf.02
Kompresja transakcji - pełna	clearingConfirmed	 otcm.clr.cnf.02

STATUS UCZESTNIKA ROZLICZAJĄCEGO

KDPW_CCP przekazuje uczestnikowi status SUSPENDED lub DEFAULT komunikatem reda.mbs.001.01

Status SUSPENDED – oznacza, że uczestnik rozliczający został zawieszony przez KDPW_CCP - w przypadku naruszenia przez uczestnika zasad uczestnictwa, polegającego na niewykonywaniu lub nienależytym wykonaniu obowiązków wynikających z umowy o uczestnictwo.

Status DEFAULT – oznacza, że uczestnik rozliczający został uznany za niewypłacalnego przez KDPW_CCP, w przypadku, gdy w stosunku do tego uczestnika została ogłoszona upadłość, uczestnik ten stał się niewypłacalny lub w niedługim czasie nie będzie zdolny do terminowego wykonywania zobowiązań wynikających z rozliczenia transakcji.

Status ACTIVE – aktywny uczestnik rozliczający.

Przykład komunikatu:

Opis	Typ komunikatu	Link
Status uczestnika rozliczającego	reda.mbs.001.01	 reda.mbs.001.01.xml

AUKCJA

KDPW_CCP może uruchomić aukcję instrumentów pochodnych OTC w następujących sytuacjach:

- w procesie obsługi niewypłacalności uczestnika rozliczającego (aukcja typu HEDGE lub DEFAULT) – aukcja obowiązkowa,
- na żądanie uczestnika rozliczającego w celu terminacji transakcji (aukcja typu ONDEMAND) – aukcja nieobowiązkowa.

KDPW_CCP informuje uczestnika o planowanej aukcji komunikatem *auct.ntf.001.01* (wartość AuctionNotice w polu AuctnStag). W momencie uruchomienia aukcji wysyłany jest komunikat *auct.ntf.001.01* z warunkami aukcji (wartość NewAuction w polu AuctnStag) oraz komunikaty *clearingStatus*, gdzie prezentowane są transakcje będące przedmiotem aukcji (do każdej transakcji wysyłany jest odrębny komunikat). Uczestnik przekazuje kwotowanie komunikatem *auct.qtn.001.01*, a w odpowiedzi otrzymuje komunikat *auct.stq.001.01*. Uczestnik może przysłać kwotowania wielokrotnie w czasie trwania aukcji. W przypadku przesłania przez uczestnika kolejnego komunikatu z kwotowaniem do tej samej aukcji, poprzednio przesłane kwotowania zostają nadpisane.

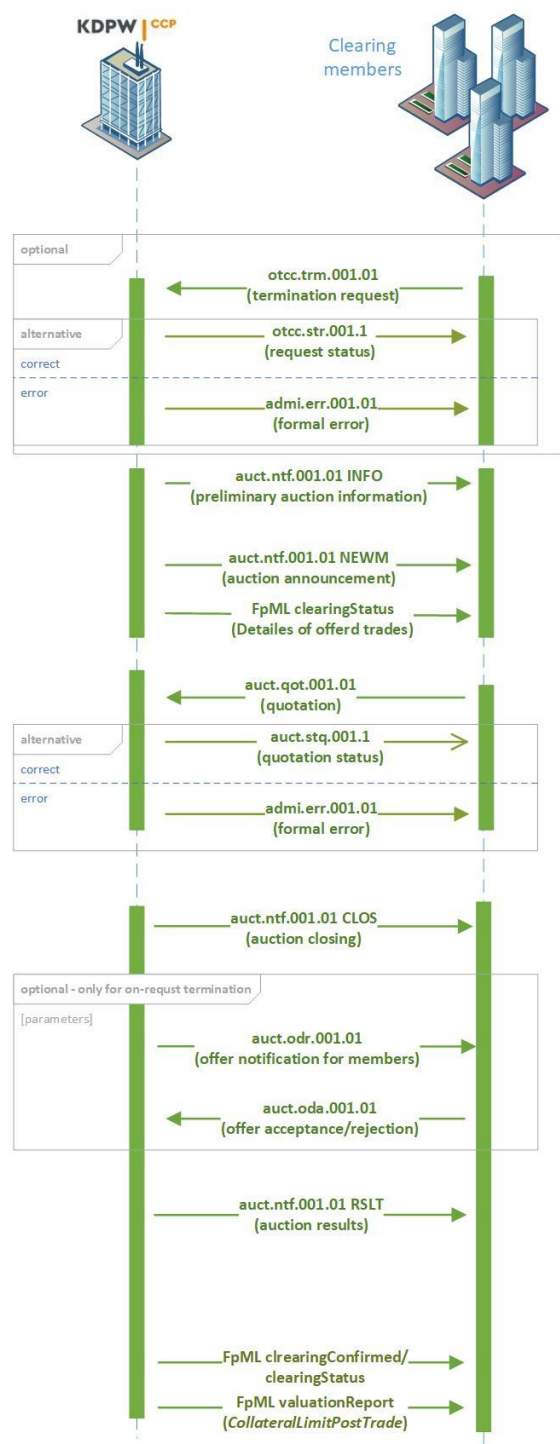
KDPW_CCP informuje uczestników o zakończeniu aukcji komunikatem *auct.ntf.001.01* (wartość AuctionClosed w polu AuctnStag), a następnie przesyła wyniki aukcji również komunikatem *auct.ntf.001.01* (wartość AuctionResult w polu AuctnStag).

Przejęte transakcje z aukcji podlegają procesowi rozliczenia, o czym uczestnik informowany jest komunikatami: *clearingConfirmed* - komunikat o przyjęciu transakcji do rozliczeń lub *clearingStatus* – status transakcji (wysyłany w przypadku aukcji na żądanie, gdy przyjęcie transakcji spowodowałoby przekroczenie limitu zabezpieczeń) oraz *valuationReport* – komunikat dotyczący zabezpieczeń i limitu (CollateralLimitPostTrade).

W przypadku anulowania przez KDPW_CCP aukcji uczestnik otrzyma komunikat *auct.ntf.001.01* (wartość AuctionCancelled w polu AuctnStag).

Ponadto KDPW_CCP może z wyprzedzeniem przesłać uczestnikom portfel na aukcję, umożliwiając wcześniejsze przygotowanie się do aukcji (np. gdy aukcja planowana jest w kolejnym dniu roboczym).

Przepływ komunikatów w procesie aukcji został przedstawiony na poniższym schemacie.



Przykład komunikatu:

Opis	Typ komunikatu	Link
Wstępna informacja o aukcji	auct.ntf.001.01	 KDPW_CCP_auct.ntf.0 01.01_AuctionNotice.x
Warunki transakcji, będących przedmiotem aukcji	clearingStatus	 KDPW_CCP_clearingSt atus_01_aukcja.xml
Przekazanie kwotowania	auct.qtn.001.01	 KDPW_CCP_auct.qtn.0 01.01.xml
Status kwotowania	auct.stq.001.01	 KDPW_CCP_auct.stq.0 01.01.xml
Wyniki aukcji dla uczestnika przejmującego transakcje	auct.ntf.001.01	 KDPW_CCP_auct.ntf.0 01.01_AuctionResult.xr
Potwierdzenie rozliczenia	clearingConfirmed	 KDPW_CCP_clearingC onfirmed_01 - aukcja.
Wymagany depozyt zabezpieczający oraz wykorzystanie limitów	valuationReport	 KDPW_CCP_valuation Report_wiele_tradeld

TERMINACJA NA ŻĄDANIE

Uczestnik rozliczający może wysłać do KDPW_CCP żądanie uruchomienia aukcji w celu terminacji jednej lub wielu transakcji zarejestrowanych na kontach rozliczeniowych powiązanych z jednym kontem PB. Możliwa jest również częściowa terminacja transakcji, wtedy uczestnik wskazuje w komunikacie nominał danej transakcji podlegający terminacji.

Uczestnik przesyła żądanie terminacji komunikatem *otcc.trm.001.01*. W odpowiedzi na otrzymane żądanie KDPW_CCP przekazuje komunikat *otcc.str.001.01*. W przypadku przekazania przez uczestnika poprawnego komunikatu, KDPW_CCP przeprowadzi aukcję.

Aukcja przebiega w sposób opisany w punkcie powyżej. Po zakończeniu aukcji, tj. po wysłaniu komunikatu *auct.ntf.001.01* (wartość *AuctionClosed* w polu *AuctnStag*), do uczestnika żądającego terminacji transakcji wysyłany jest komunikat *auct.odr.001.01* z najlepszą ofertą otrzymaną na aukcji. Uczestnik akceptuje lub odrzuca ofertę za pomocą komunikatu *auct.oda.001.01*. Nieprzesłanie poprawnego komunikatu w określonym czasie jest równoznaczne z odrzuceniem przez uczestnika oferty. W takim przypadku oraz w sytuacji, gdy uczestnik prześle komunikat *auct.oda.001.01* zbyt późno, otrzymuje komunikat *auct.stq.001.01*.

Po akceptacji/odrzuceniu oferty, uczestnicy kwotujący otrzymują komunikat z wynikami aukcji *auct.ntf.001.01* (wartość *AuctionResult* w polu *AuctnStag*), a następnie do uczestnika wygrywającego aukcję oraz uczestnika żądającego terminacji transakcji wysyłane są komunikaty *clearingConfirmed*/ *clearingStatus* oraz *valuationReport* (*CollateralLimitPostTrade*), informujące odpowiednio o akceptacji/statusie transakcji oraz wymaganym depozycie zabezpieczającym.

Przykłady komunikatów:

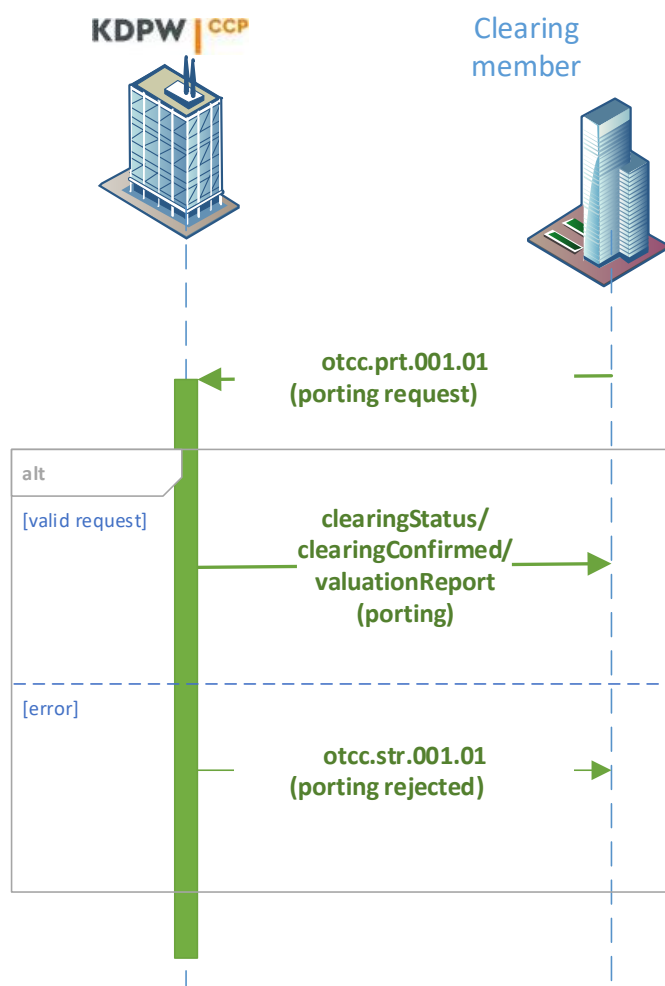
Opis	Typ komunikatu	Link
Żądanie terminacji transakcji	otcc.trm.001.01	 KDPW_CCP_otcc.trm.0 01.01.xml
Status zlecenia	otcc.str.001.01	 KDPW_CCP_Terminati onStatus.xml
Wyniki aukcji	auct.ntf.001.01	 KDPW_CCP_auct.ntf.0 01.01_AuctionResult.xr
Prośba o akceptację wyników aukcji na żądanie	auct.odr.001.01	 KDPW_CCP_auct.odr. 001.01.xml
Akceptacja wyniku aukcji na żądanie	auct.oda.001.01	 KDPW_CCP_auct.oda. 001.01.xml

Status kwotowania – w przypadku braku przesłania akceptu w zdefiniowanym czasie	auct.stq.001.01	 KDPW_CCP_auct.stq.0 01.01_LACK.xml
---	-----------------	--

PORTING TRANSAKCI

Uczestnik rozliczający może zlecić przeniesienie transakcji z jednego konta rozliczeniowego na inne swoje konto rozliczeniowe w ramach tego samego konta PB. Nie jest możliwy porting z konta z rozrachunkiem na konto z depozytem.

W celu wykonania portingu wykorzystywany jest komunikat *otcc.prt.001.01*, w którym uczestnik wskazuje m.in. źródłowy i docelowy identyfikator konta oraz opcjonalnie identyfikator(y) transakcji. W przypadku braku wskazania identyfikatorów transakcji, portingowi podlegają wszystkie transakcje zarejestrowane na wskazanym koncie źródłowym. W wyniku przeprowadzonego portingu KDPW_CCP przekazuje uczestnikowi komunikaty *clearingConfirmed*, *clearingStatus* i *valuationReport* (w funkcji *CollateralLimit*) albo *otcc.str.001.01* w przypadku odrzucenia zlecenia. W odniesieniu do konta źródłowego KDPW_CCP wysyła *clearingStatus* ze statusem *Ported*.



Komunikat *clearingConfirmed* - potwierdzenia rozliczenia przekazywany po portingu różni się od typowej informacji o nowo zawartej transakcji sekcją *OriginatingEvent*, przyjmującą wartość 'Porting'. Docelowy identyfikator konta znajduje się w sekcji *trade*.

Przykłady komunikatów wykorzystywanych w procesie portingu transakcji:

Opis	Typ komunikatu	Link
Zlecenie portingu transakcji	otcc.prt.001.01	 KDPW_CCP_otcc.prt.0 01.01.xml
Status zlecenia portingu	otcc.str.001.01	 KDPW_CCP_PortingSt atus.xml
Wynik portingu transakcji	clearingConfirmed	 KDPW_CCP_clearingC onfirmed_porting_FRA
Status transakcji	clearingStatus	 KDPW_CCP_clearingSt atus_porting_01_porti
Wymagany depozyt zabezpieczający oraz wykorzystanie limitów	valuationReport	 KDPW_CCP_valuation Report_wiele_tradel

ODRZUCENIE KOMUNIKATU (MESSAGEREJECTED)

Komunikaty FpML przychodzące do systemu KDPW_CCP podlegają kontroli wstępnej. W przypadku odrzucenia komunikatu uczestnik otrzymuje zwrótnie komunikat *messageRejected* o następującej strukturze:



W polu *reasonCode* przekazywane jest 4-znakowe oznaczenie kodu błędu.

W polu *description* znajduje się dodatkowy opis tekstowy błędu.

Jeżeli przychodzący komunikat posiada istotne błędy uniemożliwiające identyfikację rodzaju komunikatu, do uczestnika przesyłany jest standardowy komunikat błędu formalnego: *admi.err.001.01*.

Przykład komunikatu informującego o odrzuceniu komunikatu:

Opis	Typ komunikatu	Link
Odrzucenie komunikatu	messageRejected	 KDPW_CCP_message Rejected.xml

RAPORTY

KDPW_CCP udostępnia uczestnikom rozliczającym dwa rodzaje raportów:

- raporty EOD – wysyłane automatycznie w procesie końca dnia,
- raporty na żądanie – wysyłane w odpowiedzi na zapytanie uczestnika.

1. Raporty EOD

KDPW_CCP wysyła uczestnikom w procesie końca dnia następujące raporty:

- Raport Daily Variation, komunikat *otcc.vtn.001.01* – prezentuje wycenę wszystkich transakcji własnych uczestnika rozliczającego oraz jego klientów zarejestrowanych na poszczególnych kontach na koniec danego dnia,
- Raport Payments, komunikat *otcc.pmt.001.01* – prezentuje wszystkie płatności kuponowe oraz płatności typu initial fee/upfront fee (FEE) rozliczane kolejnego dnia roboczego zgodnie z konwencją dla danej waluty,

- Raport Coupons fixing, komunikat *otcc.cpn.001.01* – prezentuje wszystkie zmienne płatności kuponowe, dla których w danym dniu została ustalona zmienna stawka referencyjna,
- Raport NPV per Leg, komunikat *otcc.npv.001.01* – prezentuje wycenę poszczególnych rodzajów przepływów dla każdej transakcji,
- Raport New Trades, komunikat *otcc.trn.001.01* – prezentuje wszystkie transakcje przyjęte do rozliczenia przez KDPW_CCP w danym dniu będące na kontach uczestnika na koniec tego dnia. Raport nie zawiera transakcji, które uległy kompresji danego dnia,
- Raport Settled Trades, komunikat *otcc.trs.001.01* – prezentuje wszystkie transakcje własne uczestnika rozliczającego oraz jego klientów zarejestrowane na poszczególnych kontach, które wygasły danego dnia. Dla FRA datą wygaśnięcia jest data rozliczenia (effective date), dla transakcji swap jest to data zapadalności (maturity date).

Powyższe raporty zastępują dotychczasowe *externalReports* przesyłane w komunikacie *otcd.ntf.001.01* (komunikaty Z.1).

2. Raporty na żądanie

KDPW_CCP udostępnia uczestnikom następujące raporty na żądanie:

- Raport Cash flows, komunikat *otcc.cfl.001.01* – prezentuje wszystkie przepływy pieniężne dla wszystkich transakcji na kontach danego uczestnika,
- Raport All Trades, komunikat *otcc.tra.001.01* – prezentuje wszystkie transakcje przyjęte do rozliczenia przez KDPW_CCP i aktywne na datę na jaką generowany jest raport.

Uczestnik wysyła do KDPW_CCP żądanie raportu komunikatem *otcc.rqs.001.01*, podając identyfikator raportu (CFLW - raport Cash Flows lub TRAD - raport All Trades). Opcjonalnie uczestnik może podać datę, na jaką ma zostać wygenerowany raport (w przypadku niepodania daty, wysyłane są ostatnie dostępne dane wg stanu na koniec dnia) lub konto PA (w przypadku braku konta, dane dla wszystkich kont PA danego uczestnika). W odpowiedzi na błędny komunikat *otcc.rqs.001.01*, wysyłany jest komunikat statusowy *otcc.str.001.01*, informujący o błędzie.

Powyższe komunikaty zastępują dotychczasowe komunikaty z grupy Z.2 (żądanie raportu *executeReportRequest* wysyłane komunikatem *otcd.rqi.001.01*) oraz Z.3 (*externalReports* wysyłane w komunikacie *otcd.rsi.001.01*).

Przykłady komunikatów:

Opis	Typ komunikatu	Link
Raport Cash flows	<i>otcc.cfl.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.cfl.001.01.xml
Raport Coupons fixing	<i>otcc.cpn.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.cpn.001.01.xml

Raport NPV per Leg	<i>otcc.npv.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.npv. 001.01.xml
Raport Payments	<i>otcc.pmt.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.pmt. 001.01.xml
Raport Daily Variation	<i>otcc.vtn.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.vtn.0 01.01.xml
Żądanie przekazania raportu	<i>otcc.rqs.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.rqs.0 01.01.xml
Komunikat statusowy	<i>otcc.str.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.str.0 01.01.xml
Raport Settled Trades	<i>otcc.trs.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.trs.0 01.01.xml
Raport New Trades	<i>otcc.trn.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.trn.0 01.01.xml
Raport All Trades	<i>otcc.tra.001.01</i>	 KDPW_CCP_otcc.tra.0 01.01.xml

POZOSTAŁE KOMUNIKATY XML OBECNIE FUNKCJONUJĄCE

Bez zmian pozostają struktury komunikatów dotyczących:

- zarządzania kontami rozliczeniowymi - acmt.rqa.002.02, acmt.rqc.001.03, acmt.rqc.002.01, acmt.sta.002.02, acmt.stc.001.03, acmt.stc.002.01,
- zarządzania środkami pieniężnymi i niepieniężnymi wniesionymi na zabezpieczenia - colr.ins.001.02 i colr.sts.001.03.
- aktualizacji funduszu zabezpieczającego – colr.sgf.002.03.

Załącznik 1 – Lista komunikatów FpML wykorzystywanych w KDPW_CCP

Komunikaty FpML zostały podzielone na tzw. widoki (views), grupujące poszczególne obszary funkcjonalne. Poniższa tabela zawiera podsumowanie typów komunikatów FpML obsługiwanych w systemie KDPW_CCP, wraz ze schematami XSD przypisanymi do



fpml-main-5-12.xsd

poszczególnych widoków: **Confirmation View**

Nazwa typu komunikatu	Opis
<i>clearingConfirmed</i> (otcm.clr.cnf.01)	Potwierdzenie rozliczenia transakcji w KDPW_CCP. Potwierdzenie przejęcia transakcji po portingu.
<i>clearingConfirmed</i> (otcm.clr.cnt.01)	Potwierdzenie wykonania kompresji transakcji.
<i>clearingStatus</i> (otcm.clr.sts.01)	Status transakcji
<i>clearingRefused</i> (otcm.clr.rfs.01)	Odmowa rozliczenia transakcji



fpml-main-5-12.xsd

Reporting View

Nazwa typu komunikatu	Opis
<i>valuationReport</i> (otcm.val.rep.01)	Raport rozliczeń, Wykorzystanie limitów zabezpieczeń: • automatycznie po przyjęciu transakcji - CollateralLimitPostTrade; • automatycznie do transakcji oczekującej na przyjęcie do rozliczeń - CollateralLimitTradeState; • w odpowiedzi na pytanie uczestnika o poziom wykorzystania limitu - CollateralLimitOnRequest; • w odpowiedzi na pytanie uczestnika o wpływ transakcji hipotetycznej- CollateralLimitWhatIf; • w odpowiedzi na wykonany lub odrzucony porting CollateralLimit; • wezwanie do uzupełnienia zabezpieczeń - MarginCall.

requestValuationReport (otcm.req.val.01)	Zapytanie o limit zabezpieczeń
 fpml-main-5-12.xsd Pre-trade View	
Nazwa typu komunikatu	Opis
requestMarginQuote (otcm.req.mrg.01)	Zapytanie o hipotetyczną transakcję (<i>what if</i>)
messageRejected (otcm.msg.rjc.01)	Odrzucenie komunikatu – wspólny dla wszystkich widoków

Załącznik 2 - Schematy kodowe (coding schemes)

Dla przekazywania wartości wg ustalonego standardu lub schematu w wybranych polach komunikatów FpML wskazywana jest nazwa zastosowanego standardu – globalnego lub lokalnego – w postaci adresu URI.

W KDPW_CCP przewiduje się stosowanie następujących schematów kodowych:

Opis	Adres URI
Identyfikator komunikatu	http://www.kdpwccp.pl/otc/message-id
Identyfikator transakcji KDPW_CCP	http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-id
Identyfikator instrukcji KDPW_CCP	http://www.kdpwccp.pl/otc/instruction-id
Identyfikator transakcji Markit	http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-id-markit
Identyfikator instrukcji Markit	http://www.kdpwccp.pl/otc/instruction-id-markit
Identyfikator BetaCleared Markit	http://www.kdpwccp.pl/otc/betacleared-id-markit
Identyfikator instrukcji nadany przez uczestnika rozliczającego (wykorzystywany np. w zapytaniu <i>what if</i>)	http://www.kdpwccp.pl/otc/instruction-id-party
Identyfikator oferty	http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-offered-id
Identyfikacja uczestnika (identyfikator KDPW_CCP)	http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id
Identyfikacja instytucji Markit	http://www.kdpwccp.pl/otc/party-id-markit
Identyfikacja konta PA	http://www.kdpwccp.pl/otc/account-id-PA
Identyfikacja konta PB	http://www.kdpwccp.pl/otc/account-id-PB
Kod błędu transakcji	http://www.kdpwccp.pl/otc/trade-error-id
Kod błędu komunikatu	http://www.kdpwccp.pl/otc/message-error-id

Załącznik 3 – Lista komunikatów xml wykorzystywanych w KDPW_CCP

Poniższa tabela zawiera podsumowanie typów komunikatów XML Grupy KDPW obsługiwanych w systemie KDPW_CCP, wraz ze schematami XSD przypisanymi do poszczególnych rodzajów komunikatów.

Nazwa typu komunikatu	Opis komunikatu	PDF	XSD
<i>otcc.cfl.001.01</i>	Raport Cash flows	 otcc.cfl.001.01.pdf	 otcc.cfl.001.01.xsd
<i>otcc.cpn.001.01</i>	Raport Coupons fixing	 otcc.cpn.001.01.pdf	 otcc.cpn.001.01.xsd
<i>otcc.npv.001.01</i>	Raport NPV per Leg	 otcc.npv.001.01.pdf	 otcc.npv.001.01.xsd
<i>otcc.pmt.001.01</i>	Raport Payments	 otcc.pmt.001.01.pdf	 otcc.pmt.001.01.xsd
<i>otcc.vtn.001.01</i>	Raport Daily Variation	 otcc.vtn.001.01.pdf	 otcc.vtn.001.01.xsd
<i>otcc.rqs.001.01</i>	Żądanie przekazania raportu	 otcc.rqs.001.01.pdf	 otcc.rqs.001.01.xsd
<i>otcc.str.001.01</i>	Komunikat statusowy	 otcc.str.001.01.pdf	 otcc.str.001.01.xsd
<i>otcc.trn.001.01</i>	Raport New Trades	 otcc.trn.001.01.pdf	 otcc.trn.001.01.xsd
<i>otcc.tra.001.01</i>	Raport All Trades	 otcc.tra.001.01.pdf	 otcc.tra.001.01.xsd
<i>otcc.trs.001.01</i>	Raport Settled Trades	 otcc.trs.001.01.pdf	 otcc.trs.001.01.xsd

<i>otcc.prt.001.01</i>	Zlecenie portingu	 otcc.prt.001.01.pdf	 otcc.prt.001.01.xsd
<i>otcc.trm.001.01</i>	Żądanie terminacji transakcji na aukcji	 otcc.trm.001.01.pdf	 otcc.trm.001.01.xsd
<i>auct.oda.001.01</i>	Akceptacja wyniku aukcji na żądanie	 auct.oda.001.01.pdf	 auct.oda.001.01.xsd
<i>auct.odr.001.01</i>	Wynik aukcji na żądanie	 auct.odr.001.01.pdf	 auct.odr.001.01.xsd
<i>auct.ntf.001.01</i>	Ogłoszenie warunków aukcji	 auct.ntf.001.01.pdf	 auct.ntf.001.01.xsd
<i>auct.qtn.001.01</i>	Przekazanie kwotowania	 auct.qtn.001.01.pdf	 auct.qtn.001.01.xsd
<i>auct.stq.001.01</i>	Status kwotowania	 auct.stq.001.01.pdf	 auct.stq.001.01.xsd
<i>colr.mrg.003.03¹</i>	Płatności z tytułu depozytów zabezpieczających i pozostałych komponentów rozliczeń OTC	 colr.mrg.003.03.pdf	 colr.mrg.003.03.xsd
<i>reda.mbs.001.01</i>	Status uczestnika rozliczającego	 reda.mbs.001.01.pdf	 reda.mbs.001.01.xsd

¹ Zmiana struktury komunikatu wynika ze zmiany modelu obliczeń depozytów zabezpieczających w związku z wprowadzeniem depozytów dodatkowych tzw. depozytów add-on - pismo o syg. CCP/ZW/ 487 /2021 z dnia 9 lipca 2021 r. i pismo o syg. CCP/ZW/622/2021 z dnia 30 września 2021 r.