

RAPORTOWANIE SFTR

(zgłaszanie transakcji REPO rozliczanych przez KDPW_CCP z udziałem uczestników rozliczających do repozytorium transakcji KDPW)

Historia zmian

17.01.2022 – wersja 1.0	Utworzenie dokumentu
04.04.2022 – wersja 1.1	Aktualizacja pól, identyfikatora RTN, scenariuszy

Spis treści:

1. Dane KDPW_CCP	3
2. Wstęp	3
3. Scenariusze raportowania transakcji REPO.....	4
4. Informacje dotyczące kontrahenta	4
5. Dane dotyczące depozytu zabezpieczającego.....	20
6. Kod porfela zabezpieczeń.....	23
7. Unikatowy identyfikator transakcji RTN i UTI	23
7.1. Identyfikator RTN i UTI do transakcji	23
8. Przekazywanie zabezpieczeń klientów do SFTR.....	24
9. Rekoncylacja.....	24

1. Dane KDPW_CCP

LEGAL NAME

KDPW_CCP SPÓŁKA AKCYJNA (KDPW_CCP)

LEGAL ENTITY IDENTIFIER (LEI)

2594000K576D5CQXI987

TRADE REPOSITORY

KDPW

2. Wstęp

Celem tego dokumentu jest przedstawienie dokonywania zgłoszeń dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych do repozytoriów transakcji określonych:

- ✓ ROZPORZĄDZENIE PARLAMENTU EUROPEJSKIEGO I RADY (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012
- ✓ ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2019/356 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających szczegółowe informacje dotyczące transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, które należy zgłaszać repozytoriom transakcji;
- ✓ ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2019/357 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w sprawie dostępu do szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przechowywanych w repozytoriach transakcji;
- ✓ ROZPORZĄDZENIE WYKONAWCZE KOMISJI (UE) 2019/363 z dnia 13 grudnia 2018 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i częstotliwości dokonywania zgłoszeń szczegółowych informacji dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych do repozytoriów transakcji zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 oraz zmieniające rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) nr 1247/2012 w odniesieniu do stosowania kodów sprawozdawczych w zgłoszeniach dotyczących instrumentów pochodnych;
- ✓ ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2019/358 z dnia 13 grudnia 2018 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych w zakresie gromadzenia, weryfikacji, agregacji, porównywania i publikacji danych dotyczących transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych przez repozytoria transakcji;
- ✓ https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma70-151-2838_guidelines_on_reporting_under_sftr.pdf;
- ✓ Pytania i odpowiedzi oraz obowiązujące standardy komunikatów służących do zgłaszania transakcji <https://www.esma.europa.eu/policy-activities/post-trading/sftr-reporting>;

Zakres raportowania KDPW_CCP obejmuje wszystkie transakcje repo rozliczane przez KDPW_CCP w obrocie zorganizowanym. Transakcje te zgłaszane będą 'trade by trade' (NEWT' – Transaction). Zgłoszone transakcje podlegać będą codziennej aktualizacji w zakresie zabezpieczeń wniesionych do KDPW_CCP (MARGIN) i wyceny

zabezpieczenia (COLU). Zgłoszenia transakcji repo będą wysyłane w T+1 każdego dnia roboczego KDPW_CCP według stanu na dzień T.

3. Scenariusze raportowania transakcji REPO

Zgłoszenie	Kontrahent zobowiązany do zgłoszenia transakcji	UTI	Kod identyfikacyjny drugiego kontrahenta	Strona kontraktu, po której znajduje się kontrahent	Miejsce realizacji transakcji	Kod identyfikacyjny CCP	Kod identyfikacyjny CDPW
1	Uczestnik rozliczający	UTIO 01	CCP	'TAKE'	MIC	KDPW_CCP	KDPW
2	CCP	UTIO 01	Uczestnik rozliczający	'GIVE'	MIC	KDPW_CCP	KDPW
3	Klient	UTIO 04	Uczestnik rozliczający	'TAKE'	MIC	KDPW_CCP	KDPW
4	Uczestnik rozliczający	UTIO 04	Klient	'GIVE'	MIC	KDPW_CCP	KDPW
5	Klient, który jest UR	UTIO 05	CCP	'TAKE'	MIC	KDPW_CCP	KDPW
6	CCP	UTIO 05	Klient, który jest UR	'GIVE'	MIC	KDPW_CCP	KDPW

4. Informacje dotyczące kontrahenta

Rozdział zawiera opis w jaki sposób KDPW_CCP wypełnia pola Tabeli 1 „Counterparty Data” zgodnie z referencjami. Sposób wypełniania pól jest zależny od wskaźnika typu zgłoszenia AT znajdującego się w nagłówkach kolumn. Zamieszczone przykłady prezentują rodzaj raportowanych transakcji STR kupno/sprzedaż i są raportowane zgodnie z wytycznymi ESMA Guidelines - Reporting under Article 4 and 12 SFTR.

Zgłoszenia transakcji repo przekazywane będą komunikatem auth.052.001.01 – komunikat służący do przekazania szczegółów transakcji.

Tabela 1 – Szczegółowe dane kontrahenta dla raportu KDPW_CCP z uczestnikiem rozliczającym

TABLE 1 COUNTERPARTY DATA			TRADE LEVEL			
TABLE	FIELD NO	FIELD NAME	Opis	NEW TRANSACTION (NEWT)	TRANSACTION (CORR lub ETRM)	COLLATERAL UPDATE (COLU)
1	1	Reporting timestamp	Znacznik czasu zgłoszenia	Data i godzina zgłoszenia do RT	Data i godzina zgłoszenia do RT	Data i godzina zgłoszenia do RT
1	2	Report submitting entity	Niepowtarzalny kod identyfikujący podmiot dokonujący zgłoszenia. Jeżeli dokonanie zgłoszenia powierzono osobie trzeciej lub drugiemu kontrahentowi – niepowtarzalny kod identyfikujący ten podmiot.	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQXI987	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQXI987	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQXI987

1	3	Reporting counterparty	Niepowtarzalny kod identyfikujący kontrahenta dokonującego zgłoszenia	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987
1	4	Nature of the reporting counterparty	Wskazanie, czy kontrahent dokonujący zgłoszenia jest kontrahentem finansowym czy niefinansowym.	"F"	"F"	[puste]
1	5	Sector of the reporting counterparty	Jeden kod lub większa liczba kodów, które klasyfikują charakter działalności gospodarczej kontrahenta dokonującego zgłoszenia. Jeżeli kontrahentem dokonującym zgłoszenia jest kontrahent finansowy – wszystkie odpowiednie kody zawarte w taksonomii dla kontrahentów finansowych i mające zastosowanie do tego kontrahenta. Jeżeli kontrahent dokonujący zgłoszenia jest kontrahentem niefinansowym, wszystkie odpowiednie kody zawarte w taksonomii dla kontrahentów niefinansowych i mające zastosowanie do tego kontrahenta. Jeżeli zgłoszono więcej niż jeden rodzaj działalności, kody podawane są w porządku odzwierciedlającym względne znaczenie odpowiadających im rodzajów działalności.	"CCP" ¹	"CCPS"	[puste]
1	6	Additional sector classification	Jeżeli kontrahent dokonujący zgłoszenia jest przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) lub alternatywnym funduszem inwestycyjnym (AFI) – kod określający, czy jest on funduszem inwestycyjnym typu ETF lub funduszem rynku pieniężnego (FRP). Jeżeli kontrahent dokonujący zgłoszenia jest alternatywnym funduszem inwestycyjnym (AFI) lub kontrahentem niefinansowym prowadzącym działalność finansową lub ubezpieczeniową lub w zakresie nieruchomości – kod określający, czy kontrahent ten jest funduszem inwestycyjnym inwestującym w nieruchomości (REIT).	[puste]	[puste]	[puste]

¹ Tylko w przypadku zgłoszenia transakcji za KDPW_CCP.

1	7	Branch of the reporting counterparty	W przypadku gdy kontrahent dokonujący zgłoszenia zawiera transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych za pośrednictwem oddziału – kod identyfikujący ten oddział.	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych ²	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych
1	8	Branch of the other counterparty	W przypadku gdy drugi kontrahent zawiera transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych za pośrednictwem oddziału – kod identyfikujący ten oddział.	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych ³	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych	ISO 3166-1 alfa-2 – kod kraju składający się z dwóch znaków alfabetycznych
1	9	Counterparty side	Wskazanie, czy kontrahent dokonujący zgłoszenia jest przekazującym zabezpieczenie czy też przyjmującym zabezpieczenie zgodnie z art. 4 rozporządzenia wykonawczego Komisji (UE) 2019/363 (1)	Give or Take	Give or Take	[puste]
1	10	Entity responsible for the report	Jeżeli kontrahent finansowy jest odpowiedzialny za dokonanie zgłoszenia w imieniu drugiego kontrahenta zgodnie z art. 4 ust. 3 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 (2), niepowtarzalny kod identyfikujący tego kontrahenta finansowego. Jeżeli spółka zarządzająca jest odpowiedzialna za dokonanie zgłoszenia w imieniu przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) zgodnie z art. 4 ust. 3 wspomnianego rozporządzenia, niepowtarzalny kod identyfikujący tę spółkę zarządzającą. Jeżeli zarządzający alternatywnym funduszem inwestycyjnym (ZAFI) jest odpowiedzialny za dokonanie zgłoszenia w imieniu alternatywnego funduszu inwestycyjnego (AFI) zgodnie z art. 4 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2015/2365, niepowtarzalny kod identyfikujący tego ZAFI.	“2594000K576D5CQXI987”	“2594000K576D5CQXI987”	[puste]
1	11	Other counterparty	Niepowtarzalny kod identyfikujący podmiot, z którym kontrahent dokonujący zgłoszenia zawarł transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych. W przypadku osoby prywatnej należy	LEI UR	LEI UR	LEI UR

² pole wypełniane w przypadku oddziału banku

³ pole wypełniane w przypadku oddziału banku

			konsekwentnie podawać kod klienta.			
1	12	Country of the other Counterparty	Kod państwa, w którym znajduje się siedziba statutowa drugiego kontrahenta, lub jeśli drugi kontrahent jest osobą fizyczną – kod państwa zamieszkania.	Kod kraju kontrahenta	Kod kraju kontrahenta	[puste]
1	13	Beneficiary	Jeżeli beneficjent kontraktu nie jest jego kontrahentem, kontrahent dokonujący zgłoszenia musi wskazać tego beneficjenta, podając niepowtarzalny kod lub, w przypadku osób prywatnych, kod klienta stosowany konsekwentnie i nadany przez podmiot prawny, z którego usług korzysta ta osoba prywatna.	[puste]	[puste]	[puste]
1	14	Tri-party agent	Niepowtarzalny kod identyfikujący osobę trzecią, której kontrahent dokonujący zgłoszenia zlecił na zasadzie outsourcingu obsługę posttransakcyjną transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych (w stosownych przypadkach).	[puste]	[puste]	[puste]
1	15	Broker	Niepowtarzalny kod podmiotu, który działa jako pośrednik kontrahenta dokonującego zgłoszenia, nie stając się stroną samej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych. W przypadku transakcji udzielenia pożyczki papierów wartościowych broker nie obejmuje pełnomocnika pożyczkodawcy („agent lender”).	[puste]	[puste]	[puste]
1	16	Clearing member	W przypadku gdy transakcja jest rozliczana – niepowtarzalny kod identyfikujący odpowiedzialnego członka rozliczającego kontrahenta dokonującego zgłoszenia.	LEI	LEI	LEI
1	17	CSD	Niepowtarzalny kod uczestnika lub uczestnika pośredniego CDPW kontrahenta dokonującego zgłoszenia. Jeżeli zarówno uczestnik, jak i uczestnik pośredni CDPW są zaangażowani w transakcję – kod uczestnika pośredniego. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	LEI agenta ds. rozrachunku	LEI agenta ds. rozrachunku	[puste]
1	18	Agent lender	Niepowtarzalny kod pełnomocnika pożyczkodawcy („agent lender”) uczestniczącego w transakcji udzielenia pożyczki papierów wartościowych.	[puste]	[puste]	[puste]

Tabela 2 – szczegółowe dane dotyczące zgłoszenia

2	1	Unique Transaction Identifier (UTI)	Niepowtarzalne odniesienie przypisane transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych w celu jej zidentyfikowania.	UTI	UTI	UTI
2	2	Report tracking number	W przypadku transakcji wynikających z rozliczenia, zgłasza się pierwotny UTI, a mianowicie UTI pierwotnej transakcji dwustronnej. Nie wymaga się jednak zgłaszania pierwotnego UTI przez kontrahentów będących kontrahentami centralnymi („CCP”), którzy rozliczyli transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych. Jeżeli transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych została zrealizowana w systemie obrotu i rozliczona w tym samym dniu – numer wygenerowany przez system obrotu i niepowtarzalny dla jej realizacji.	RTN	[RTN	[puste]
2	3	Event date	Dzień, w którym miało miejsce zdarzenie objęte obowiązkiem zgłaszania i dotyczące transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, ujęte w zgłoszeniu. W przypadku rodzajów czynności „Valuation update” (aktualizacja wyceny), „Collateral update” (aktualizacja zabezpieczenia), „Reuse update” (aktualizacja ponownego wykorzystania), „Margin update” (aktualizacja depozytu zabezpieczającego) – data, w odniesieniu do której podaje się informacje ujęte w zgłoszeniu.	Data transakcji	Data obowiązywania	Data obowiązywania
2	4	Type of SFT	Rodzaj transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych zgodnie z definicjami w art. 3 pkt 7–10 rozporządzenia (UE) 2015/2365.	“REPO”	“REPO”	“REPO”
2	5	Cleared	Wskazanie, czy nastąpiło centralne rozliczenie.	TRUE	TRUE	[puste]
2	6	Clearing timestamp	Data i godzina dokonania rozliczenia	Data i godzina nowacji	Data i godzina nowacji	[puste]
2	7	CCP	W przypadku rozliczonych kontraktów – niepowtarzalny kod CCP, który dokonał rozliczenia kontraktu.	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQXI98 7	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQXI98 7	[puste]

2	8	Trading venue	Niepowtarzalny kod identyfikujący system, w którym zrealizowano transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych. Jeżeli transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych została zawarta poza rynkiem regulowanym i została dopuszczona do obrotu – kod MIC „XOFF”. Jeżeli transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych została zawarta poza rynkiem regulowanym, ale nie została dopuszczona do obrotu – kod MIC „XXXX”.	[TBSP]/[XXXX] ⁴	[TBSP]/[XXXX]	[puste]
2	9	Master agreement type	Odniesienie do rodzaju umowy ramowej, w ramach której kontrahenci zawarli transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych.	“OTHR”	“OTHR”	“OTHR”
2	10	Other master agreement type	Nazwa umowy ramowej. Pole to wypełnia się jedynie w przypadku, gdy w polu 9 zgłasza się „OTHR”.	RegulaminKDPWCCP	RegulaminKDPWCCP	RegulaminKDPWCCP
2	11	Master agreement version	W stosownych przypadkach podanie roku umowy ramowej właściwej dla zgłaszanej transakcji.	[puste]	[puste]	[puste]
2	12	Execution timestamp	Data i godzina realizacji transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.	Data i godzina zawarcia transakcji	Data i godzina zawarcia transakcji	[puste]
2	13	Value date (Start date)	Ustalona umownie między kontrahentami data wymiany środków pieniężnych, papierów wartościowych lub towarów w zamian za zabezpieczenie w odniesieniu do etapu otwarcia (kasowego) transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.	Data i godzina otwarcia repo	Data i godzina otwarcia repo	[puste]
2	14	Maturity date (End date)	Ustalona umownie między kontrahentami data wymiany środków pieniężnych, papierów wartościowych lub towarów w zamian za zabezpieczenie w odniesieniu do etapu zamknięcia (terminowego) transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych. Informacji tych nie zgłasza się w odniesieniu do transakcji odkupu zawartych na czas nieokreślony.	Data wygaśnięcia transakcji	Data wygaśnięcia transakcji	[puste]
2	15	Termination date	Data zakończenia transakcji w przypadku pełnego przedterminowego zakończenia transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.	[puste]	Data terminacji transakcji	[puste]
2	16	Minimum notice period	Minimalna liczba dni roboczych, w których jeden z kontrahentów musi poinformować drugiego kontrahenta o zakończeniu transakcji.	[puste]	[puste]	[puste]

⁴ Kod [XXXX] używany będzie w przypadku zgłoszenia transakcji zawartej na aukcji w procesie obsługi niewypłacalności.

2	17	Earliest call-back date	Najwcześniejszy termin, w którym pożyczkodawca środków pieniężnych ma prawo do przedterminowego odzyskania części środków pieniężnych lub zakończenia transakcji.	[puste]	[puste]	[puste]
2	18	General collateral Indicator	Wskazanie, czy transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych jest przedmiotem uzgodnienia dotyczącego zabezpieczenia ogólnego. W przypadku transakcji udzielenia pożyczki papierów wartościowych pole to odnosi się do papierów wartościowych przekazanych jako zabezpieczenie, a nie do papieru wartościowego przekazanego w ramach pożyczki. W przypadku transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych objętych uzgodnieniem dotyczącym zabezpieczenia ogólnego podaje się kod „GENE”. Uzgodnienie dotyczące zabezpieczenia ogólnego określa uzgodnienie dotyczące zabezpieczenia w odniesieniu do transakcji, w ramach której przekazujący zabezpieczenie może wybrać papier wartościowy, który ma zostać przekazany jako zabezpieczenie, spośród stosunkowo dużej liczby papierów wartościowych spełniających uprzednio określone kryteria. W przypadku transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych objętych uzgodnieniem dotyczącym zabezpieczenia szczególnego podaje się kod „SPEC”. Uzgodnienie dotyczące zabezpieczenia szczególnego oznacza uzgodnienie dotyczące zabezpieczenia transakcji, w ramach której przyjmujący zabezpieczenie wymaga przekazania przez przekazującego zabezpieczenie określonego międzynarodowego numeru identyfikującego papier wartościowy („kod ISIN”).	“SPEC”	“SPEC”	[puste]
2	19	DBV indicator	Wskazanie, czy transakcja została rozliczona z zastosowaniem mechanizmu DBV.	FALSE	FALSE	[puste]

2	20	Method used to provide collateral	Wskazanie, czy zabezpieczenie w ramach transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych podlega uzgodnieniu dotyczącemu zabezpieczeń polegającemu na przeniesieniu tytułu, uzgodnieniu dotyczącemu zabezpieczeń finansowych w formie gwarancji lub uzgodnieniu dotyczącemu zabezpieczeń finansowych w formie gwarancji z prawem wykorzystania. Jeżeli do przekazania zabezpieczenia wykorzystano więcej niż jedną metodę, w tym polu należy podać pierwotne uzgodnienie dotyczące zabezpieczenia.	"TTCA"	"TTCA"	[puste]
2	21	Open term	Wskazanie, czy transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych ma umownie ustalony termin zapadalności czy też nie ma takiego terminu. W przypadku transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych bez terminu zapadalności należy określić kod „True” (prawda) oraz kod „False” (fałsz) w przypadku transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych z terminem zapadalności.	FALSE	FALSE	[puste]
2	22	Termination optionality	Wskazanie, czy transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych jest transakcją z możliwością zakończenia w dowolnym momencie lub transakcją z możliwością przedłużenia terminu zapadalności.	[NOAP]	[NOAP]	[puste]
2	23	Fixed rate	W przypadku transakcji odkupu stopa procentowa w ujęciu rocznym dla kwoty głównej transakcji odkupu zgodnie ze wzorem obliczania dni. W przypadku transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego stopa procentowa w ujęciu rocznym dla wartości pożyczki, którą pożyczkobiorca płaci pożyczkodawcy.	[stopa repo]	[stopa repo]	[puste]
2	24	Day count convention	Metoda obliczania naliczonych odsetek od kwoty głównej dla danej stopy procentowej.	[A005]	[A005]	[puste]
2	25	Floating rate	W stosownych przypadkach – wskazanie stosowanej referencyjnej stopy procentowej, która jest aktualizowana w określonych z góry odstępach czasu przez odniesienie do rynkowej referencyjnej stopy procentowej.	[puste]	[puste]	[puste]
2	26	Floating rate reference period - time period	Okres czasu wskazujący okres odniesienia dla zmiennej stopy procentowej.	[puste]	[puste]	[puste]
2	27	Floating rate reference period	Mnożnik dla okresu czasu wskazującego okres odniesienia dla	[puste]	[puste]	[puste]

		- multiplier	zmiennej stopy procentowej określonego w polu 26.			
2	28	Floating rate payment frequency - time period	Okres czasu wskazujący częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej.	[puste]	[puste]	[puste]
2	29	Floating rate payment frequency - multiplier	Mnożnik dla okresu czasu wskazującego częstotliwość płatności według zmiennej stopy procentowej określonego w polu 28.	[puste]	[puste]	[puste]
2	30	Floating rate reset frequency - time period	Okres czasu wskazujący częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej.	[puste]	[puste]	[puste]
2	31	Floating rate reset frequency - multiplier	Mnożnik dla okresu czasu wskazującego częstotliwość aktualizacji zmiennej stopy procentowej określonego w polu 30.	[puste]	[puste]	[puste]
2	32	Spread	Liczba punktów bazowych, które należy dodać do zmiennej stopy procentowej lub od niej odjąć, aby określić stopę procentową pożyczki.	[puste]	[puste]	[puste]
2	33	Margin lending currency amount	Kwota pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego w danej walucie.	[puste]	[puste]	[puste]
2	34	Margin lending currency	Waluta pożyczki związanej z transakcją z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego.	[puste]	[puste]	[puste]
2	35	Adjusted rate	Stopa procentowa określona w tabeli stóp procentowych.	[puste]	[puste]	[puste]
2	36	Rate date	Data, od której stosowana jest stopa procentowa.	[puste]	[puste]	[puste]
2	37	Principal amount on value date	Wartość środków pieniężnych, która ma zostać rozliczona na dzień waluty transakcji.	Wartość transakcji dla pierwszej nogi	Wartość transakcji dla pierwszej nogi	[puste]
2	38	Principal amount on maturity date	Wartość gotówkowa, którą należy rozliczyć w terminie zapadalności transakcji.	Wartość transakcji dla drugiej nogi	Wartość transakcji dla drugiej nogi	[puste]
2	39	Principal amount currency	Waluta kwoty głównej.	PLN	PLN	[puste]
2	40	Type of asset	Wskazanie rodzaju składnika aktywów będącego przedmiotem transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych.	[puste]	[puste]	[puste]
2	41	Security identifier	Identyfikacja papieru wartościowego będącego przedmiotem transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]

2	42	Classification of a security	Kod według klasyfikacji instrumentów finansowych („kod CFI”) papieru wartościowego będącego przedmiotem transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]
2	43	Base product	Produkt bazowy określony według klasyfikacji towarów w tabeli 5 załącznika I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363.	[puste]	[puste]	[puste]
2	44	Sub product	Podrodzaj produktu określony w klasyfikacji towarów w tabeli 5 załącznika I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363. To pole wymaga określonego produktu bazowego w polu 43.	[puste]	[puste]	[puste]
2	45	Further sub product	Następny podrodzaj produktu określony w tabeli klasyfikacji towarów. To pole wymaga określonego podrodzaju produktu w polu 44.	[puste]	[puste]	[puste]
2	46	Quantity or nominal amount	Ilość lub kwota nominalna papieru wartościowego lub towaru będącego przedmiotem transakcji finansowanej z użyciem papierów finansowych. W przypadku obligacji – łączna kwota nominalna oznaczająca liczbę obligacji pomnożoną przez ich wartość nominalną. W przypadku innych papierów wartościowych lub towarów – ich ilość.	[puste]	[puste]	[puste]
2	47	Unit of measure	Jednostka miary, w ramach której wyrażono ilość. Pole to ma zastosowanie do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]
2	48	Currency of nominal amount	W przypadku zgłoszenia kwoty nominalnej – waluta kwoty nominalnej.	[puste]	[puste]	[puste]
2	49	Security or commodity price	W przypadku transakcji udzielenia i zaciągnięcia pożyczki papierów wartościowych i towarów – cena papieru wartościowego lub towaru wykorzystana do obliczenia wartości pożyczki. W przypadku transakcji zwrotnej kupno-sprzedaż cena papieru wartościowego lub towaru stosowana do obliczenia kwoty transakcji dla części kasowej tej transakcji.	[puste]	[puste]	[puste]
2	50	Price currency	Waluta, w jakiej wyrażona jest cena papieru wartościowego lub towaru.	[puste]	[puste]	[puste]
2	51	Security quality	Kod stosowany do klasyfikacji ryzyka kredytowego papieru wartościowego.	[puste]	[puste]	[puste]
2	52	Maturity of the security	Termin zapadalności papieru wartościowego. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]

2	53	Jurisdiction of the issuer	Jurysdykcja właściwa dla emitenta papieru wartościowego. W przypadku papierów wartościowych wyemitowanych przez zagraniczną jednostkę zależną – jurysdykcja właściwa dla jednostki dominującej najwyższego szczebla lub, jeżeli nie jest ona znana, jurysdykcja właściwa dla jednostki zależnej. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]
2	54	LEI of the issuer	Kod LEI emitenta papieru wartościowego Pole to nie ma zastosowania do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]
2	55	Security type	Kod stosowany do klasyfikacji rodzaju papieru wartościowego.	[puste]	[puste]	[puste]
2	56	Loan value	Wartość pożyczki, tj. ilość lub kwota nominalna pożyczki, pomnożona przez cenę zawartą w polu 49.	[puste]	[puste]	[puste]
2	57	Market value	Wartość rynkowa papierów wartościowych lub towarów będących przedmiotem zaciągnięcia lub udzielenia pożyczki.	[puste]	[puste]	[puste]
2	58	Fixed rebate rate	Stała stopa procentowa (stopa uzgodniona do zapłaty przez pożyczkodawcę za reinwestycję zabezpieczenia gotówkowego pomniejszonego o opłatę za udzielenie pożyczki) płacona przez pożyczkodawcę papieru wartościowego lub towaru na rzecz pożyczkobiorcy (dodatnia stawka rabatu) lub przez pożyczkobiorcę na rzecz pożyczkodawcy (ujemna stawka rabatu) od salda przekazanego zabezpieczenia gotówkowego.	[puste]	[puste]	[puste]
2	59	Floating rebate rate	Wskazanie referencyjnej stopy procentowej zastosowanej do obliczenia stawki rabatu (stopa uzgodniona do zapłaty przez pożyczkodawcę za reinwestycję zabezpieczenia gotówkowego pomniejszonego o opłatę za udzielenie pożyczki) płaconej przez pożyczkodawcę papieru wartościowego lub towaru na rzecz pożyczkobiorcy (dodatnia stawka rabatu) lub przez pożyczkobiorcę na rzecz pożyczkodawcy (ujemna stawka rabatu) od salda przekazanego zabezpieczenia gotówkowego.	[puste]	[puste]	[puste]
2	60	Floating rebate rate reference period - time period	Okres czasu wskazujący okres odniesienia dla zmiennej stawki rabatu.	[puste]	[puste]	[puste]
2	61	Floating rebate rate reference period - multiplier	Mnożnik dla okresu czasu wskazującego okres odniesienia dla zmiennej stawki rabatu określonego w polu 60.	[puste]	[puste]	[puste]

2	62	Floating rebate rate payment frequency - time period	Okres czasu wskazujący częstotliwość płatności według zmiennej stawki rabatu.	[puste]	[puste]	[puste]
2	63	Floating rebate rate payment frequency - multiplier	Mnożnik dla okresu czasu wskazującego częstotliwość płatności według zmiennej stawki rabatu określonego w polu 62.	[puste]	[puste]	[puste]
2	64	Floating rebate rate reset frequency - time period	Okres czasu wskazujący częstotliwość aktualizacji zmiennej stawki rabatu.	[puste]	[puste]	[puste]
2	65	Floating rebate rate reset frequency - multiplier	Mnożnik dla okresu czasu wskazującego częstotliwość aktualizacji zmiennej stawki rabatu określonego w polu 64.	[puste]	[puste]	[puste]
2	66	Spread of the rebate rate	Spread zmiennej stawki rabatu wyrażony w punktach bazowych.	[puste]	[puste]	[puste]
2	67	Lending fee	Opłata, którą pożyczkobiorca papierów wartościowych lub towarów płaci pożyczkodawcy.	[puste]	[puste]	[puste]
2	68	Exclusive arrangements	W przypadku transakcji udzielenia i zaciągnięcia pożyczki papierów wartościowych – wskazanie, czy pożyczkobiorca ma wyłączność na zaciąganie pożyczek z portfela papierów wartościowych pożyczkodawcy. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]
2	69	Outstanding margin loan	Łączna kwota pożyczek związanych z transakcjami z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego w walucie bazowej.	[puste]	[puste]	[puste]
2	70	Base currency of outstanding margin loan	Waluta bazowa pozostających do spłaty pożyczek związanych z transakcjami z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego.	[puste]	[puste]	[puste]
2	71	Short market value	Wartość rynkowa pozycji krótkiej w walucie bazowej.	[puste]	[puste]	[puste]
2	72	Uncollateralised SL flag	Wskazanie, czy transakcja udzielenia pożyczki papierów wartościowych jest niezabezpieczona. Tego pola nie należy stosować, jeżeli kontrahenci uzgodnią zabezpieczenie transakcji, ale nie jest jeszcze znane szczegółowe przypisanie zabezpieczenia.	[puste]	[puste]	[puste]
2	73	Collateralisation of net exposure	Wskazanie, czy zabezpieczenie przekazano w odniesieniu do wartości ekspozycji netto, a nie na potrzeby pojedynczej transakcji.	FALSE	FALSE	FALSE

2	74	Value date of the collateral	Jeżeli transakcje były zabezpieczone na podstawie wartości ekspozycji netto, ostatnia data waluty zawarta w pakiecie kompensowania transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych, uwzględniając wszystkie transakcje, w odniesieniu do których przekazano zabezpieczenie.	[puste]	[puste]	[puste]
2	75	Type of collateral component	Wskazanie rodzaju składnika zabezpieczenia.	[puste]	[puste]	[puste]
2	76	Cash collateral amount	Kwota środków pieniężnych przekazanych jako zabezpieczenie pożyczek papierów wartościowych lub towarów.	[puste]	[puste]	[puste]
2	77	Cash collateral currency	Waluta zabezpieczenia gotówkowego	[puste]	[puste]	[puste]
2	78	Identification of a security used as collateral	Identyfikacja papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie Pole to nie ma zastosowania do towarów.	ISIN papierów na zabezpieczenie	[puste]	ISIN papierów na zabezpieczenie
2	79	Classification of a security used as collateral	Kod CFI papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	CFI papierów na zabezpieczenie	[puste]	CFI papierów na zabezpieczenie
2	80	Base product	Produkt bazowy określony według klasyfikacji towarów w tabeli 5 załącznika I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363.	[puste]	[puste]	[puste]
2	81	Sub - product	Podrodzaj produktu określony w klasyfikacji towarów w tabeli 5 załącznika I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363. To pole wymaga określonego produktu bazowego w polu 80.	[puste]	[puste]	[puste]
2	82	Further sub - product	Następny podrodzaj produktu określony w klasyfikacji towarów w tabeli 5 w załączniku I do rozporządzenia wykonawczego (UE) 2019/363. To pole wymaga określonego podrodzaju produktu w polu 81.	[puste]	[puste]	[puste]
2	83	Collateral quantity or nominal amount	Ilość lub kwota nominalna papieru wartościowego lub towaru wykorzystanego jako zabezpieczenie. W przypadku obligacji – łączna kwota nominalna oznaczająca liczbę obligacji pomnożoną przez wartość nominalną. W przypadku innych papierów wartościowych lub towarów – ich ilość.	Wartość nominalna	[puste]	Wartość nominalna
2	84	Collateral unit of measure	Jednostka miary, w ramach której wyrażono ilość zabezpieczenia. Pole to ma zastosowanie do towarów.	[puste]	[puste]	[puste]
2	85	Currency of collateral nominal amount	W przypadku zgłoszenia nominalnej wartości zabezpieczenia – waluta kwoty nominalnej.	PLN	[puste]	PLN

2	86	Price currency	Waluta, w jakiej wyrażona jest cena składnika zabezpieczenia.	PLN	[puste]	PLN
2	87	Price per unit	Cena jednostkowa w odniesieniu do składnika zabezpieczenia, w tym narosłe odsetki za oprocentowane papiery wartościowe wykorzystywane do wyceny papieru wartościowego lub towaru.	Brudna cena	[puste]	Brudna cena
2	88	Collateral market value	Wartość rynkowa indywidualnego składnika zabezpieczenia w walucie, w jakiej wyrażona jest cena.	Wartość jednostkowa zabezpieczenia	[puste]	Wartość jednostkowa zabezpieczenia
2	89	Haircut or margin	<p>W przypadku transakcji odkupu i transakcji zwrotnych kupno-sprzedaż każdą redukcję wartości zabezpieczenia określa się poprzez odniesienie do środka kontroli ryzyka zastosowanego w odniesieniu do zabezpieczenia, na poziomie ISIN, przy czym wartość tego zabezpieczenia jest obliczana jako wartość rynkowa aktywów pomniejszona o określony procent.</p> <p>W przypadku transakcji udzielenia pożyczki papierów wartościowych procent każdej redukcji wartości zabezpieczenia określa się poprzez odniesienie do środka kontroli ryzyka zastosowanego w odniesieniu do zabezpieczenia, na poziomie ISIN lub na poziomie portfela, przy czym wartość tego zabezpieczenia jest obliczana jako wartość rynkowa aktywów pomniejszona o określony procent.</p> <p>W odniesieniu do transakcji z obowiązkiem uzupełnienia zabezpieczenia kredytowego – procent wymogu dotyczącego depozytu zabezpieczającego zastosowany do całego portfela zabezpieczeń utrzymywanego na rachunku brokerskim klienta. W tym polu należy określić wartości rzeczywiste w przeciwieństwie do wartości szacunkowych lub wartości domyślnych.</p>	"0"	[puste]	"0"
2	90	Collateral quality	Kod stosowany do klasyfikacji ryzyka papieru wartościowego wykorzystywanego jako zabezpieczenie.	"INVG"	[puste]	"INVG"
2	91	Maturity of the security	Termin zapadalności papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	Data w formacie YYYY-MM-RR	[puste]	Data w formacie YYYY-MM-RR

2	92	Jurisdiction of the issuer	Jurysdykcja właściwa dla emitenta papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie. W przypadku papierów wartościowych wyemitowanych przez zagraniczną jednostkę zależną zgłasza się jurysdykcję właściwą dla jednostki dominującej najwyższego szczebla lub, jeżeli nie jest ona znana, jurysdykcję właściwą dla jednostki zależnej. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	PL	[puste]	PL
2	93	LEI of the issuer	Kod LEI emitenta papieru wartościowego wykorzystanego jako zabezpieczenie. Pole to nie ma zastosowania do towarów.	259400R9L8QEP0TPXS3 1	[puste]	259400R9L8QEP0TPXS31
2	94	Collateral type	Kod stosowany do klasyfikacji rodzaju papieru wartościowego wykorzystywanego jako zabezpieczenie.	“GOVS”	[puste]	“GOVS”
2	95	Availability for collateral re-use	Wskazanie, czy przyjmujący zabezpieczenie może ponownie wykorzystać przekazane papiery wartościowe jako zabezpieczenie.	[false]	[puste]	[false]
2	96	Collateral basket identifier	Jeżeli koszyk zabezpieczeń można zidentyfikować za pomocą kodu ISIN – kod ISIN koszyka zabezpieczeń. Jeżeli koszyka zabezpieczeń nie można zidentyfikować za pomocą kodu ISIN, w polu tym należy wpisać kod „NTAV”.	[puste]	[puste]	[ISIN]
2	97	Portfolio code	Jeżeli transakcja podlega rozliczeniu i jest zawarta w portfelu transakcji, w ramach których następuje wymiana depozytów zabezpieczających, do identyfikacji portfela służy niepowtarzalny kod wyznaczony przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia. Jeżeli portfel transakcji obejmuje również instrumenty pochodne podlegające zgłoszeniu na podstawie rozporządzenia (UE) nr 648/2012, kod portfela jest taki sam jak kod zgłoszony na podstawie rozporządzenia (UE) nr 648/2012.	Kod portfela zabezpieczeń	Kod portfela zabezpieczeń ⁵	[puste]

⁵ Pole wypełniane tylko dla AT=CORR

2	98	Action type	<p>W zgłoszeniu określa się jeden z następujących rodzajów czynności:</p> <p>a) transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych zgłaszaną po raz pierwszy określa się rodzajem czynności „New” (nowe);</p> <p>b) zmianę uprzednio zgłoszonej transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych określa się rodzajem czynności „Modification” (zmiana). Zmiana ta obejmuje aktualizację wcześniejszego zgłoszenia, które wykazuje daną pozycję, w celu odzwierciedlenia nowych transakcji ujętych w tej pozycji; c) wycenę papieru wartościowego lub towaru będącego przedmiotem transakcji udzielania pożyczki papierów wartościowych lub towarów określa się rodzajem czynności „Valuation update” (aktualizacja wyceny);</p> <p>d) zmianę szczegółowych danych dotyczących zabezpieczenia, w tym jego wyceny, określa się rodzajem czynności „Collateral update” (aktualizacja zabezpieczeniu); e) anulowanie błędnie złożonego całego zgłoszenia w przypadku, gdy transakcja finansowana z użyciem papierów wartościowych nigdy nie została zawarta lub nie podlegała wymogom w zakresie zgłaszania takich transakcji, ale została zgłoszona do repozytorium transakcji przez pomyłkę, określa się rodzajem czynności „Error” (błąd); f) korektę pól danych zgłoszonych błędnie w poprzednim zgłoszeniu określa się rodzajem czynności „Correction” (korekta);</p> <p>g) zakończenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych bez terminu zapadalności lub przedterminowe zakończenie transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych z terminem zapadalności określa się rodzajem czynności „Termination/Early termination” (zakończenie/przedterminowe zakończenie); h) transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych, która ma zostać zgłoszona jako nowa transakcja i jest również zawarta w odrębnym zgłoszeniu pozycji w tym samym dniu, określa się „Position component” (składnik pozycji).</p>	“ NEWT”	“CORR” lub “ETRM”	“COLU”
---	----	-------------	--	---------	-------------------	--------

2	99	Level	Wskazanie, czy zgłoszenie jest dokonywane na poziomie transakcji czy pozycji. Zgłoszenie na poziomie pozycji może być wykorzystywane jedynie jako uzupełnienie zgłoszenia na poziomie transakcji w celu zgłoszenia zdarzenia posttransakcyjnego i tylko wtedy, gdy poszczególne transakcje na produktach zamiennych zostały zastąpione pozycją.	'TCTN'	'TCTN'	'TCTN'
---	----	-------	---	--------	--------	--------

5. Dane dotyczące depozytu zabezpieczającego

Rozdział zawiera opis w jaki sposób KDPW_CCP wypełnia pola w Tabeli 3 „Margin Data” zgodnie z referencjami.

Sposób wypełniania pól jest zależny od wskaźnika typu akcji AT znajdującego się w nagłówkach kolumn. Wartość zabezpieczeń wniesionych tytułem depozytów dla ASO zostanie przekazana w komunikacie auth.070.001.01 – komunikat służący do przekazania Margin. Raportowanie wartości zabezpieczeń odbywa się w walucie PLN, według stanu zabezpieczeń na koniec dnia.

Tabela 3 – Szczegółowe dane dotyczące depozytu zabezpieczającego

TABLE 3 MARGINS			Opis pola	TRADE LEVEL - ACTION TYPE	
TABLE	FIELD NO	FIELD NAME		NEWT	MARGIN UPDATE (MARU)
3	1	Reporting timestamp	Data i godzina przekazania zgłoszenia do repozytorium transakcji.	Data i godzina zgłoszenia do RT	Data i godzina zgłoszenia do RT
3	2	Event date	Dzień, w którym miało miejsce zdarzenie objęte obowiązkiem zgłaszania i dotyczące transakcji finansowanej z użyciem papierów wartościowych, ujęte w zgłoszeniu. W przypadku rodzajów czynności „Valuation update” (aktualizacja wyceny), „Collateral update” (aktualizacja zabezpieczenia), „Reuse update” (aktualizacja ponownego wykorzystania), „Margin update” (aktualizacja depozytu zabezpieczającego) – data, w odniesieniu do której podaje się informacje ujęte w zgłoszeniu.	Data zgłoszenia	Data aktualizacji zabezpieczeń
3	3	Report submitting entity	Niepowtarzalny kod identyfikujący podmiot dokonujący zgłoszenia. W przypadku gdy dokonanie zgłoszenia powierzono osobie trzeciej lub drugiemu kontrahentowi – niepowtarzalny kod identyfikujący ten podmiot.	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987
3	4	Reporting Counterparty	Niepowtarzalny kod identyfikujący kontrahenta dokonującego zgłoszenia.	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987

3	5	Entity responsible for the report	<p>Jeżeli kontrahent finansowy jest odpowiedzialny za dokonanie zgłoszenia w imieniu drugiego kontrahenta zgodnie z art. 4 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2015/2365 – niepowtarzalny kod identyfikujący tego kontrahenta finansowego. Jeżeli spółka zarządzająca jest odpowiedzialna za dokonanie zgłoszenia w imieniu przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) zgodnie z art. 4 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2015/2365 – niepowtarzalny kod identyfikujący tę spółkę zarządzającą. Jeżeli zarządzający alternatywnym funduszem inwestycyjnym (ZAFI) jest odpowiedzialny za dokonanie zgłoszenia w imieniu alternatywnego funduszu inwestycyjnego (AFI) zgodnie z art. 4 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2015/2365 – niepowtarzalny kod identyfikujący tego ZAFI.</p>	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987	LEI KDPW_CCP 2594000K576D5CQX1987
3	6	Other counterparty	Niepowtarzalny kod identyfikujący podmiot, z którym kontrahent dokonujący zgłoszenia zawarł transakcję finansowaną z użyciem papierów wartościowych.	LEI UR	LEI UR
3	7	Portfolio code	Do identyfikacji portfela transakcji, w ramach których następuje wymiana depozytów zabezpieczających, służy niepowtarzalny kod wyznaczony przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia. Jeżeli portfel transakcji obejmuje również instrumenty pochodne podlegające zgłoszeniu na podstawie rozporządzenia (UE) nr 648/2012, kod portfela jest taki sam jak kod zgłoszony na podstawie rozporządzenia (UE) nr 648/2012.	kod portfela zabezpieczeń	kod portfela zabezpieczeń
3	8	Initial margin posted	Wartość początkowego depozytu zabezpieczającego wniesionego na rzecz drugiego kontrahenta przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia. Jeżeli początkowy depozyt zabezpieczający wniesiono na poziomie portfela, w polu tym należy podać łączną wartość początkowego depozytu zabezpieczającego wniesionego w odniesieniu do tego portfela.	Suma wartości IM wpłaconego przez UR ⁶	Suma wartości IM wpłaconego przez UR ⁷
3	9	Currency of the initial margin posted	Waluta wniesionego początkowego depozytu zabezpieczającego.	PLN	PLN
3	10	Variation margin posted	Wartość zmiennego depozytu zabezpieczającego, w tym wartość rozliczonych środków pieniężnych, wniesionego na rzecz drugiego kontrahenta przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia. Jeżeli zmienny depozyt zabezpieczający wniesiono na poziomie portfela, w polu tym należy podać łączną wartość zmiennego depozytu zabezpieczającego wniesionego w odniesieniu do tego portfela.	[puste]	[puste]

⁶ Wartości te uzupełnianie są przez uczestnika rozliczającego w relacji z KDPW_CCP.

⁷ Wartości te uzupełnianie są przez uczestnika rozliczającego w relacji z KDPW_CCP.

3	11	Currency of the variation margins posted	Waluta wniesionego zmiennego depozytu zabezpieczającego.	PLN	PLN
3	12	Initial margin received	Wartość początkowego depozytu zabezpieczającego otrzymanego przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia od drugiego kontrahenta. Jeżeli początkowy depozyt zabezpieczający otrzymano na poziomie portfela, w polu tym należy podać łączną wartość początkowego depozytu zabezpieczającego otrzymanego w odniesieniu do tego portfela.	Suma wartości depozytu zabezpieczającego otrzymanego przez KDPW_CCP ⁸	Suma wartości depozytu zabezpieczającego otrzymanego przez KDPW_CCP ⁹
3	13	Currency of the initial margin received	Waluta otrzymanego początkowego depozytu zabezpieczającego.	PLN	PLN
3	14	Variation margin received	Wartość zmiennego depozytu zabezpieczającego, w tym wartość rozliczonych środków pieniężnych, otrzymanego przez kontrahenta dokonującego zgłoszenia od drugiego kontrahenta. Jeżeli zmienny depozyt zabezpieczający otrzymano na poziomie portfela, w polu tym należy podać łączną wartość zmiennego depozytu zabezpieczającego otrzymanego w odniesieniu do tego portfela.	[puste]	[puste]
3	15	Currency of the variation margins received	Waluta otrzymanego zmiennego depozytu zabezpieczającego.	PLN	PLN
3	16	Excess collateral posted	Wartość nadwyżki wniesionego zabezpieczenia w stosunku do wymaganego zabezpieczenia.	Wartość wstępnego depozytu wpłaconego przez UR ¹⁰	Wartość wstępnego depozytu wpłaconego przez UR ¹¹
3	17	Currency of the excess collateral posted	Waluta wniesionej nadwyżki zabezpieczenia.	PLN	PLN
3	18	Excess collateral received	Wartość nadwyżki otrzymanego zabezpieczenia w stosunku do wymaganego zabezpieczenia.	Suma wartości depozytu rozliczeniowego otrzymanego przez KDPW_CCP ¹²	Suma wartości depozytu rozliczeniowego otrzymanego przez KDPW_CCP ¹³
3	19	Currency of the excess collateral received	Waluta otrzymanej nadwyżki zabezpieczenia.	PLN	PLN
3	20	Action type	W zgłoszeniu określa się jeden z następujących rodzajów czynności: a) nowe saldo depozytu zabezpieczającego określa się rodzajem czynności „New” (nowe); b) zmianę szczegółowych informacji dotyczących depozytów zabezpieczających określa się rodzajem czynności „Margin update” (aktualizacja depozytu zabezpieczającego); c) anulowanie błędnie przekazanego całego zgłoszenia określa się rodzajem czynności „Error” (błąd); d) korektę pól danych zgłoszonych błędnie w poprzednim zgłoszeniu określa się rodzajem czynności „Correction” (korekta).	“NEWT”	“MARU”

⁸ Wartości te wypełnia zawsze KDPW_CCP.

⁹ Wartości te wypełnia zawsze KDPW_CCP.

¹⁰ Wartości te uzupełnianie są przez uczestnika rozliczającego w relacji z KDPW_CCP.

¹¹ Wartości te uzupełnianie są przez uczestnika rozliczającego w relacji z KDPW_CCP.

¹² Wartości te wypełnia zawsze KDPW_CCP.

¹³ Wartości te wypełnia zawsze KDPW_CCP.

6. Kod portfela zabezpieczeń

KDPW_CCP wypełnia pole „Kod portfela” - pole 97 w Tabeli 2 i pole 7 w Tabeli 3, wskazują identyfikator konta zabezpieczeń na które będą wnoszone i przechowywane zabezpieczenia w KDPW_CCP. Identyfikatory konta zabezpieczeń użyte w raportach będą zbudowane w następujący sposób:

- ✓ dla relacji KDPW_CCP z UR i UR z KDPW_CCP – prefiks 'PRTFL' + kod Uczestnika Rozliczającego, np. „PRTFL5002”.
- ✓ dla relacji UR z klientem i klient z UR - prefiks 'PRTFL' + kod podmiotu zawierającego transakcję repo, np. „PRTFL07AA”.

7. Unikatowy identyfikator transakcji RTN i UTI

Unikalne identyfikatory transakcji (UTI) służą do identyfikacji transakcji zgłoszonych. Długość identyfikatora UTI to maksymalnie 52 znaki.

7.1. Identyfikator RTN i UTI do transakcji

Identyfikator RTN transakcji jest generowany i przypisywany do transakcji w chwili nowacji w KDPW_CCP.

Algorytm budowy identyfikatora RTN dla transakcji

Pola nr	Długość	Opis	Wartość
1-3	3	Stała 'E01'	E01
4-7	4	Kod MIC KDPW_CCP	KDPW
8-10	3	Stała wartość	000
11-25	15	Identyfikator z TBSP	TBSP21029402208
26	1	Strona transakcji	B/S
27-38	12	ISIN obligacji	PL0000000103

Identyfikator instrukcji z TBSP - pole 'MktRef' z komunikatu sese.sts.002.02 wysłanego do uczestnika rozliczającego.

Schemat identyfikatora z TBSP BondSpot:

MICYDDDDNNNNNNX, gdzie:

- MIC – Market Identifier Code
- YY – numer roku (dwie ostatnie cyfry numeru roku)
- DDD – numer dnia w ciągu roku
- NNNNNN – numer transakcji
- X – oznaczenie kodowe, które jest usuwane w celu utworzenia numeru RTN
 - 9 – zawarcie transakcji cash/pierwszej nogi transakcji warunkowej
 - 7 – zawarcie drugiej nogi transakcji warunkowej

Przykład: TBSP21029402208 – sześć ostatnich cyfr to numer transakcji z MTS.

Oznaczenie stron:

S - strona repo

B - strona revers

Przykład: E01KDPW000TBSP21029402208SPL0000000103

Algorytm budowy identyfikatora UTI dla transakcji

UTI tworzone jest poprzez dodanie na końcu scenariusza (np. 001,004 lub 005) do identyfikatora RTN.

8. Przekazywanie zabezpieczeń klientów do SFTR

Raportowanie za pośrednictwem KDPW_CCP informacji o zabezpieczeniach złożonych przez klientów (oznaczonych indywidualnym NKK) u uczestników rozliczających jest przeprowadzane na podstawie dostarczonych do KDPW_CCP komunikatów XML, których format i struktura zostały udostępnione na stronie internetowej. Raportowanie wartości zabezpieczeń odbywa się w walucie PLN.

Konto zabezpieczeń użyte w tych raportach będzie budowane poprzez złożenie indywidualnego kodu uczestnika rozliczającego i NKK, np. „PRTFL5005ZZZZZZZ”.

Proces raportowania zabezpieczeń złożonych przez Klientów u uczestników rozliczających (UR):

- ✓ UR przekazuje do KDPW_CCP komunikat auth.mrg.001.01. Komunikat z wartością zabezpieczeń klientów jest przekazywany do SFTR dnia następnego (T+1),
- ✓ 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 KDPW_TR.
- ✓ KDPW_CCP przeprowadza kontrolę zgodności przekazanego komunikatu ze schemą,
- ✓ niezgodność komunikatu ze schemą - komunikat otrzymuje status przetwarzania informujący o niezgodności – admi.err.001.01, ze wskazaniem miejsca błędu,
- ✓ zgodność komunikatu ze schemą - komunikat otrzymuje status PEND - informujący o przyjęciu przez KDPW_CCP do dalszego przetwarzania. W odpowiedzi KDPW_CCP przekazuje do UR informację statusową auth.sts.001.01.
- ✓ w dniu T+1, po otrzymaniu informacji zwrotnej z SFTR, KDPW_CCP przekazuje do UR komunikat zawierający informację statusową (auth.sts.001.01), adekwatną do informacji przekazanej przez SFTR (PACK lub REJT),
- ✓ Status PACK - komunikat został przyjęty i przetworzony poprawnie przez SFTR, status REJT - odrzucenie komunikatu przez KDPW_TR ze wskazaniem kodu błędu z opisem powodu odrzucenia.

9. Rekoncyliacja

Poniższa tabela zawiera zakres pól podlegających porównaniu w ramach procesu rekoncyliacji wykonywanego przez repozytorium. W przypadku zdecydowanej większości pól nie jest dopuszczalna żadna tolerancja. Jedynie w przypadku trzech kategorii w pól dopuszczalne są nieznaczne różnice.

Są to:

- a. Stemple czasowe – gdzie dopuszczalna jest różnica do jednej godziny
- b. Stopy procentowe – do trzech miejsc po przecinku
- c. Pola penetrujące wartość – dopuszczalna tolerancja na poziomie: 0.0005%

Poziom tolerancji dla wszystkich porównywanych pól został zamieszczony w poniższej tabeli.

Tabela	Sekcja	Pole	Tolerancja	Data wejścia w życie
Counterparty data	NA	Reporting counterparty	Brak	2020-04-13
Counterparty data	NA	Counterparty side	Brak	2020-04-13
Counterparty data	NA	Other counterparty	Brak	2020-04-13

Transaction data	Loan	Unique Transaction Identifier ('UTI')	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Type of SFT	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Cleared	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Clearing timestamp	Jedna godzina	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	CCP	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Trading venue	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Master agreement type	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Execution timestamp	Jedna godzina	2020-04-13
Transaction data	Loan	Value date (Start date)	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Maturity date (End date)	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Termination date	Brak	2020-04-13

Tabela	Sekcja	Pole	Tolerancja	Data wejścia w życie
Transaction data	Loan	Minimum notice period	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Earliest call-back date	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	General collateral Indicator	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Delivery By Value ('DBV') indicator	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Method used to provide collateral	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Open term	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Termination optionality	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Fixed rate	Do trzech cyfr po przecinku	2020-04-13
Transaction data	Loan	Day count convention	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Floating rate	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Floating rate reference period - time period	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Floating rate reference period – multiplier	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Floating rate payment frequency - time period	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Floating rate payment frequency – multiplier	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Floating rate reset frequency - time period	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Floating rate reset frequency – multiplier	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Spread	Do trzech cyfr po przecinku	2020-04-13
Transaction data	Loan	Margin lending currency amount	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Margin lending currency	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Adjusted rate	Do trzech cyfr po przecinku	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Rate date	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Principal amount on the value date	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Principal amount on the maturity date	0.0005%	2020-04-13

Tabela	Sekcja	Pole	Tolerancja	Data wejścia w życie
Transaction data	Loan	Principal amount currency	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Type of asset	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Security identifier	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Classification of a security	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Base product	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Sub - product	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Further sub - product	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Quantity or nominal amount	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Unit of measure	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Currency of nominal amount	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Security or commodity price	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Price currency	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Security quality	Brak	2020-04-13 + 9 miesięcy
Transaction data	Loan	Maturity of the security	Brak	2020-04-13 + 9 miesięcy
Transaction data	Loan	Jurisdiction of the issuer	Brak	2020-04-13 + 9 miesięcy
Transaction data	Loan	LEI of the issuer	Brak	2020-04-13 + 9 miesięcy
Transaction data	Loan	Security type	Brak	2020-04-13 + 9 miesięcy
Transaction data	Loan	Loan value	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Market value	0.0005%	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Fixed rebate rate	Do trzech cyfr po przecinku	2020-04-13
Transaction data	Loan	Floating rebate rate	Do trzech cyfr po przecinku	2020-04-13
Transaction data	Loan	Floating rebate rate reference period - time period	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące

Tabela	Sekcja	Pole	Tolerancja	Data wejścia w życie
Transaction data	Loan	Floating rebate rate reference period - multiplier	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Floating rebate rate payment frequency - time period	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Floating rebate rate payment frequency - multiplier	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Floating rebate rate reset frequency - time period	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Floating rebate rate reset frequency - multiplier	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Spread of the rebate rate	Do trzech cyfr po przecinku	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Lending fee	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Exclusive arrangements	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Loan	Outstanding margin loan	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Base currency of outstanding margin loan	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Short market value	0.0005%	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Uncollateralised Securities Lending ('SL') flag	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Collateralisation of net exposure	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Value date of the collateral	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Type of collateral component	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Cash collateral amount	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Cash collateral currency	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Identification of a security used as collateral	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Classification of a security used as collateral	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Base product	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Collateral	Sub – product	Brak	2020-04-13

Tabela	Sekcja	Pole	Tolerancja	Data wejścia w życie
				+ 33 miesiące
Transaction data	Collateral	Further sub – product	Brak	2020-04-13 + 33 miesiące
Transaction data	Collateral	Collateral quantity or nominal amount	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Collateral unit of measure	Brak	2020-04-13 + 24 miesiące
Transaction data	Collateral	Currency of collateral nominal amount	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Price currency	Brak	2020-04-13 + 24 miesiące
Transaction data	Collateral	Price per unit	Brak	2020-04-13 + 24 miesiące
Transaction data	Collateral	Collateral market value	0.0005%	2020-04-13 + 24 miesiące
Transaction data	Collateral	Haircut or margin	Do trzech cyfr po przecinku	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Collateral quality	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Maturity date of the security	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Jurisdiction of the issuer	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	LEI of the issuer	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Collateral type	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Availability for collateral Re-use	Brak	2020-04-13
Transaction data	Collateral	Collateral basket identifier	Brak	2020-04-13
Transaction data	Loan	Level	Brak	2020-04-13
