

KDPW

KDPW
CCP

Spotkanie z klientami **KDPW TR** oraz **KDPW_CCP**

Call for evidence – uproszczenie raportowania transakcji finansowych

- 23 czerwca 2025 r. ESMA opublikowała dokument *„Call for evidence on a comprehensive approach for the simplification of financial transaction reporting”*.
- Dokument dotyczy przeglądu wymogów raportowych wynikających z regulacji MiFIR, EMIR i SFTR pod kątem uproszczenia wymogów regulacyjnych.
- Głównym celem inicjatywy ESMA jest ocena możliwości redukcji złożoności, kosztów i dublowania obowiązków raportowych przy zachowaniu jakości i użyteczności danych dla instytucji nadzorujących.
- Konsultacja ESMA ma charakter informacyjny i służy zebraniu opinii uczestników rynku przed ewentualnymi zmianami legislacyjnymi (na tym etapie każdy mógł* i nadal może uczestniczyć czynnie w pracach związanych z ewentualną deregulacją).

* Termin na wysyłanie uwag, opinii do proponowanych przez ESMA zmian minął 19 września 2025 r.

Wyzwania w obecnych reżimach raportowania wg ESMA

- Równoległe obowiązki raportowania podobnych lub tych samych informacji w ramach kilku regulacji.
- Rozbieżności w definicjach, formatach danych i procesach przekazywania informacji.
- Trudności w konsolidacji danych przez organy nadzoru (różne formaty, różne kanały dostępu).
- Wysokie koszty wdrożenia i utrzymania procesów raportowych po stronie uczestników rynku*.

***ESMA nie podaje źródeł informacji ani metodologii dot. wyliczenia podanych w dokumencie kosztów**

OPCJA 1: Redukcja duplikacji bez zmiany struktury systemów

- **Wariant 1a:** rozdzielenie zakresu raportowania wg rodzaju instrumentu:
 - np. instrumenty pochodne giełdowe raportowane tylko pod MiFIR;
 - OTC – pozostają w EMIR.

- **Wariant 1b:** rozdzielenie wg rodzaju zdarzenia:
 - transakcje zgłaszane pod MiFIR;
 - zdarzenia post-transakcyjne (wyceny, zabezpieczenia) pod EMIR i SFTR.

PROPOZYCJE ESMA - „Report once”

OPCJA 2: Stworzenie jednolitego systemu raportowania obejmującego wszystkie trzy reżimy.

- **Wariant 2a:**

- wspólna struktura danych dla MiFIR, EMIR i SFTR;
- jeden raport spełniający wszystkie wymogi.

- **Wariant 2b:**

- możliwość rozszerzenia zasady „report once” na inne ramy regulacyjne.

OPCJA 1aa: modyfikacja wariantu 1a ESMA, główne założenia:

MiFIR

- rezygnacja z raportowania derywatów ETD i OTC w ramach MiFIR;
- obowiązkowe raportowanie wyłącznie do ARM-ów (nie do 27 NCA, jak obecnie) z wykorzystaniem systemu TRACE*, jako centralnego kanału wymiany danych.

EMIR/SFTR

- raportowanie wszystkich transakcji pochodnych (ETD i OTC) tylko do repozytoriów transakcji;
- likwidacja rozdziału organizacyjnego EMIR i SFTR;
- weryfikacja obowiązku dwustronnego raportowania zgodnie z globalną harmonizacją (możliwe single-sided reporting dla określonych typów transakcji lub jasny podział obowiązków między stronami, by zmniejszyć liczbę duplikatów);
- wspólna, maszynowo czytelna dokumentacja, jasne wytyczne i narzędzia walidacyjne.

* TRACE, kanał wymiany informacji TRs <-> ESMA <-> NCAs/NCBs pod EMIR

Zmiany w raportowaniu SFTR

Marcin Wrona, Szef Zespołu Referencyjnych Baz Danych i Statystyk w Dziale Repozytorium Transakcji KDPW

Warszawa, 27 listopada 2025 roku

Spis treści

1. Zwracanie wielu kodów błędów w komunikacie statusowym.
2. Zmiany w walidacji kodu kraju emitenta instrumentu.
3. Uruchomienie środowiska TST A.

Zmiana w sposobie walidacja raportów w ramach SFTR

Proces walidacji raportów obejmuje następujące komunikaty xml:

- **auth.052.001.02** – komunikat dotyczący transakcji SFT;
- **auth.070.001.02** – komunikat dotyczący depozytów zabezpieczających (margin);
- **auth.071.001.02** – komunikat dotyczący ponownego wykorzystania, reinwestycji środków pieniężnych i źródeł finansowania (reuse);

Walidacje wykonywane są zgodnie z regułami ESMA określonymi w RTS. Informacje o błędzie przekazywane są komunikatem **auth.031.001.01**.

Aktualny sposób walidacji raportów SFTR

- Jeżeli raport w komunikacie wejściowym został poprawnie zwalidowany w komunikacie wyjściowym auth.031.001.01 przekazywana jest informacja o akceptacji raportu (ACPT).
- Jeżeli raport w komunikacie wejściowym zawiera tzw. błędy techniczne (np. niepoprawny tag xml) to w komunikacie wyjściowym auth.031.001.01 jest przekazywana informacja o odrzuceniu całego komunikatu => status CRPT.
- Jeżeli raport w komunikacie wejściowym zawiera błąd merytoryczny to walidacja raportu jest przerywana i w komunikacie wyjściowym auth.031.001.01 jest przekazywana informacja o odrzuceniu raportu (RJCT) z informacją o pierwszym napotkanym błędzie.

Różnice w sposobie walidacji raportów SFTR

Aktualny sposób walidacji	Nowy sposób walidacji
- Raport w komunikacie wejściowym odrzucany jest na pierwszym błędzie znalezionym podczas procesu walidacji, bez kontynuacji walidowania. - W komunikacie wyjściowym dla jednej transakcji może zostać zaprezentowany tylko jeden błąd.	- Raport w komunikacie wejściowym odrzucany jest na pierwszym błędzie znalezionym podczas procesu walidacji, a walidacja plików jest dalej kontynuowana. - W komunikacie wyjściowym dla jednej transakcji może zostać zaprezentowany więcej niż jeden błąd.

Przykłady – komunikat auth.052.001.02

Przykład 1 (aktualny sposób walidacji vs nowy sposób walidacji)

RSE wysyła raport do transakcji komunikatem auth.052.001.02 z błędnym kodem LEI w polu Reporting counterparty (SFT-003) i błędnym kodem MIC w polu Trading venue (SFT-023).

Aktualny sposób walidacji:

Komunikat auth.031.01.001 informuje o odrzuceniu raportu do transakcji wraz z informacją o błędzie dla walidacji SFT-003.

Nowy sposób walidacji:

Komunikat auth.031.01.001 informuje o odrzuceniu raportu do transakcji wraz z informacją o błędzie dla walidacji SFT-003 i SFT-023.

Przykłady – komunikat auth.052.001.02

Przykład 1 – sposób prezentacji wyników w auth.031.001.01

Aktualny sposób walidacji	Nowy sposób walidacji
<pre> <RcrdSts> <OrgnlRcrdId>TEST1</OrgnlRcrdId> <Sts>RJCT</Sts> <VldtnRule> <Id>SFT-003</Id> <Desc>Reporting counterparty LEI is not valid</Desc> </VldtnRule> </RcrdSts> </pre>	<pre> <RcrdSts> <OrgnlRcrdId>TEST1</OrgnlRcrdId> <Sts>RJCT</Sts> <VldtnRule> <Id>SFT-003</Id> <Desc>Reporting counterparty LEI is not valid</Desc> </VldtnRule> <VldtnRule> <Id>SFT-023</Id> <Desc>Trading venue does not contain valid ISO code</Desc> </VldtnRule> </RcrdSts> </pre>

Przykłady – komunikat auth.070.001.02

Przykład 2 (aktualny sposób walidacji vs nowy sposób walidacji)

RSE wysyła raport margin komunikatem auth.070.001.02 z błędnym kodem LEI w polu Entity responsible for report (SFM-005) i błędnym kodem LEI w polu Other counterparty (SFM-006).

Aktualny sposób walidacji:

Komunikat auth.031.01.001 informuje o odrzuceniu raportu margin wraz z informacją o błędzie dla walidacji SFM-005.

Nowy sposób walidacji:

Komunikat auth.031.01.001 informuje o odrzuceniu raportu margin wraz z informacją o błędzie dla walidacji SFM-005 i SFM-006.

Przykłady – komunikat auth.070.001.02

Przykład 2 – sposób prezentacji wyników w auth.031.001.01

Aktualny sposób walidacji	Nowy sposób walidacji
<pre><RcrdSts> <OrgnlRcrdId>TEST1</OrgnlRcrdId> <Sts>RJCT</Sts> <VldtnRule> <Id>SFM-005</Id> <Desc>Entity responsible for reporting LEI is not valid</Desc> </VldtnRule> </RcrdSts></pre>	<pre><RcrdSts> <OrgnlRcrdId>TEST1</OrgnlRcrdId> <Sts>RJCT</Sts> <VldtnRule> <Id>SFM-005</Id> <Desc>Entity responsible for reporting LEI is not valid</Desc> </VldtnRule> <VldtnRule> <Id>SFM-006</Id> <Desc>Other counterparty LEI is not valid</Desc> </VldtnRule> </RcrdSts></pre>

Przykłady – komunikat auth.071.001.02

Przykład 3 (aktualny sposób walidacji vs nowy sposób walidacji)

RSE wysyła raport reuse komunikatem auth.071.001.02 z niepoprawną datą w polu Event date (SFR-002) i błędnym kodem LEI w polu Reporting counterparty (SFR-004).

Aktualny sposób walidacji:

Komunikat auth.031.01.001 informuje o odrzuceniu raportu reuse wraz z informacją o błędzie dla walidacji SFR-002.

Nowy sposób walidacji:

Komunikat auth.031.01.001 informuje o odrzuceniu raportu reuse wraz z informacją o błędzie dla walidacji SFR-002 i SFR-004.

Przykład 3 – sposób prezentacji wyników w auth.031.001.01

Aktualny sposób walidacji	Nowy sposób walidacji
<pre><RcrdSts> <OrgnlRcrdId>TEST1</OrgnlRcrdId> <Sts>RJCT</Sts> <VldtnRule> <Id>SFR-002</Id> <Desc>Incorrect Event Date</Desc> </VldtnRule> </RcrdSts></pre>	<pre><RcrdSts> <OrgnlRcrdId>TEST1</OrgnlRcrdId> <Sts>RJCT</Sts> <VldtnRule> <Id>SFR-002</Id> <Desc>Incorrect Event Date</Desc> </VldtnRule> <VldtnRule> <Id>SFR-004</Id> <Desc>Reporting counterparty LEI is not valid</Desc> </VldtnRule> </RcrdSts></pre>

Zmiana walidacji dla pola Jurisdiction of the issuer

Dodatkowo, w ramach wdrożenia zmian w sposobie walidacji, zostanie wprowadzona weryfikacja poprawności kodu kraju przypisanego do kodu LEI emitenta papieru będącego przedmiotem pożyczki lub zabezpieczenia. Walidacja zostanie dostosowana do opisu pola Jurisdiction of the issuer z dokumentu ESMA *SFTR validation rules*:

Jurisdiction of the issuer of the security used as collateral. In case of securities issued by a foreign subsidiary, the jurisdiction of the ultimate parent company shall be reported or, if not known, the jurisdiction of the subsidiary.

Opis informuje, że kod kraju powinien być zgodny z kodem kraju emitenta, a jeżeli kod kraju spółki córki jest inny niż kod kraju spółki matki, to należy zaraportować kod kraju spółki matki.

Kontrole będą wykonywane na podstawie danych dotyczących emitenta z bazy GLEIF. W ramach aktualizacji zostaną wdrożone zmiany dla następujących kontroli:

- SFT-039 (pole Jurisdiction of the issuer w sekcji Loan);
- ERR-144 (pole Jurisdiction of the issuer w sekcji Collateral).

Udostępnienie środowiska EDU

Obok zmian w procesie walidacji w pierwszym kwartale 2026 zostanie udostępnione środowisko testowe **EDU**. Aktualnie uczestnicy mają dostęp do środowiska testowego **TST**.

Środowisko EDU jest środowiskiem testowym o charakterze edukacyjnym, pozwalającym uczestnikom na testowanie usług KDPW w wersji zgodnej ze stanem otoczenia produkcyjnego.

Środowisko TST jest środowiskiem testowym przeznaczonym do prowadzenia testów nowych usług oraz nowych lub zmienionych funkcji w ramach usług udostępnionych produkcyjnie.

Harmonogram wdrożenia

- Udostępnienie środowiska EDU:
 - - **pierwszy kwartał 2026 r.**
- Aktualizacja dokumentacji funkcjonalnej:
 - - **maj 2026 r.**
- Udostępnienie zmian dla walidacji w środowisku testowym:
 - - **wrzesień 2026 r.**
- Wdrożenie zmian dla walidacji w środowisku produkcyjnym:
 - - **15 listopada 2026 r.**

Kontakt

Repozytorium Transakcji SFTR:

email: sftr@kdpw.pl

tel: 22 537 95 26 / 22 537 94 07



EMIR – nowe pola w procesie rekoncyliacji danych

Anna Łagowska, Starszy Specjalista w Zespole ds. Raportowania i Współpracy z Nadzorcami w Dziale
Repozytorium Transakcji KDPW

Warszawa, 27 listopada 2025 roku

Spis treści

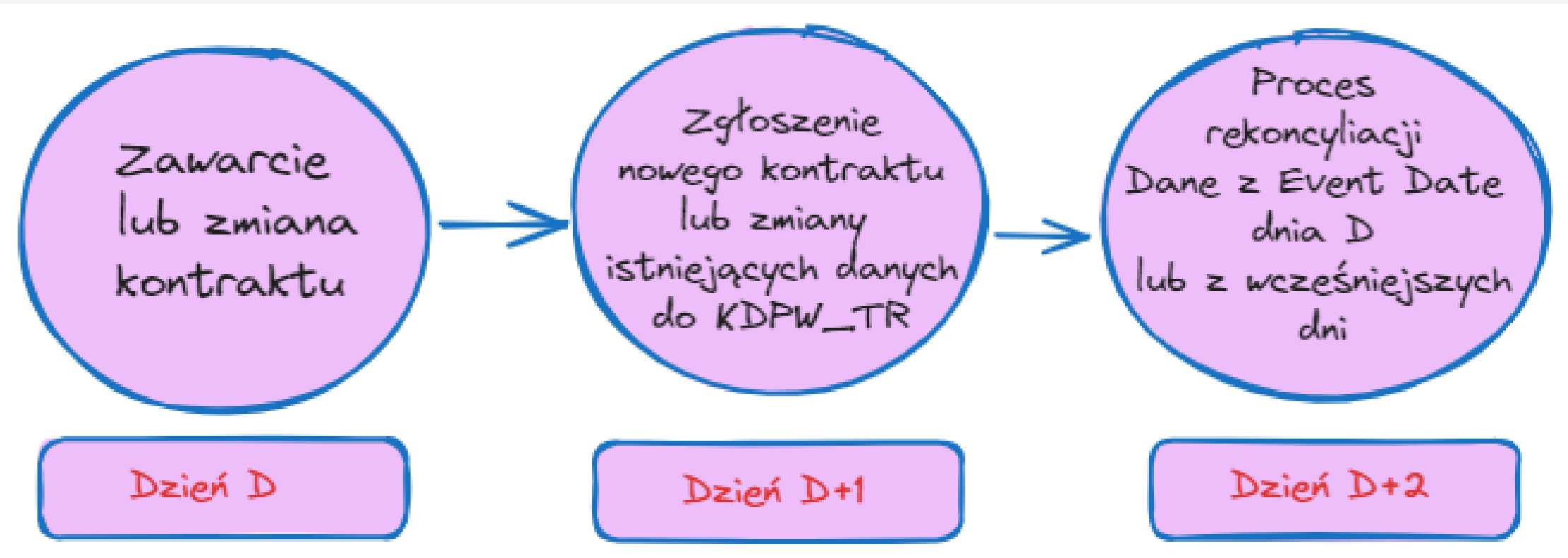
1. Przypomnienie obecnych zasad działania procesu rekonyliacji.
2. II faza wdrożenia - harmonogram.
3. II faza wdrożenia - zmiany w raportach.
4. Rekonyliacja wyceny.
5. Rekonyliacja dodatkowych pól z pozostałych sekcji tabeli walidacyjnej.

Uzgadnianie danych oparte jest na kilku kluczowych zasadach:

- Proces wykonywany jest tylko w dni robocze zgodnie z czasem UTC.
- Dni robocze wyznacza kalendarz TARGET2.
- Transakcje identyfikowane są za pomocą tripletu pól: Counterparty 1, Counterparty 2, UTI.
- Procesowi rekonsyliacji podlegają zarówno transakcje, jak i pozycje do 30 dni po terminacji/wygaśnięciu.
- Zmiany na transakcjach dokonywane w ciągu dnia są wyłączone z procesu uzgadniania. Rekonsyliacji w dniu D+2 podlega tylko ostatni zapis stanu transakcji w dniu D, który stanowią ostatnio zaraportowane lub zmodyfikowane wartości pól do dnia D+1.

Proces rekonsyliacji - przypomnienie obecnych zasad działania

Proces rekonsyliacji jest wykonywany **w dniu roboczym D+2** dla instrumentów pochodnych spełniających wymogi wejścia do procesu, jeśli data w polu Event date to D lub wcześniejsza.



Proces rekonyliacji - przypomnienie obecnych zasad działania

Do procesu rekonyliacji skierowane są wszystkie transakcje i pozycje, jeżeli spełnione zostały **łącznie** wszystkie poniższe warunki:

- Counterparty 1 (CP1) ma obowiązek raportowania, tj. jest kontrahentem mającym siedzibę w UE lub jest AFI (Alternatywny Fundusz Inwestycyjny), którego ZAFI (Zarządzający alternatywnym funduszem inwestycyjnym) ma siedzibę w UE, na podstawie informacji zawartych w bazie GLEIF.
- w polu 1.14 ('Reporting obligation of the counterparty 2') wprowadzono wartość „TRUE”.
- Transakcja lub pozycja nie otrzymała zgłoszenia AT=EROR, chyba, że po nim nastąpiło zgłoszenie AT=REVI.
- Transakcja lub pozycja jest aktywna lub była aktywna w ciągu ostatnich trzydziestu dni kalendarzowych. Za datę wygaśnięcia kontraktu uważa się wcześniejszą datę wybraną z dwóch pól: 'Expiration date' lub 'Early termination date'. W dniu Expiration date transakcje uważane są za aktywne, a w dniu Early termination uważane są już za nieaktywne.

Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - podstawa prawna

Rekonyliacja w nowym formacie została wprowadzona w ramach wejścia w życie EMIR REFIT 29.04.2024 roku. Zgodnie z Rozporządzeniem UE nr 2022/1858 proces podzielono na dwie fazy:

**W pierwszej fazie, od momentu uruchomienia REFIT (od 29.04.2024),
rekonyliacji podlega 87 pól.**

**W drugiej fazie, od 29.04.2026 zostanie dodane kolejne 61 pól,
w tym 4 pola dotyczące wyceny transakcji lub pozycji:**

2.21 - Valuation amount

2.22 - Valuation currency

2.24 - Valuation method

2.25 - Delta

Proces rekoncepcji - II faza wdrożenia - harmonogram



Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - zmiany w raportach

Zmiany w raportach **DATREC**

Dotychczas sekcja **<ValtnRcncltn>** była wypełniana domyślnie wartością NOAP.

```
<RptgRqrmnt>
  <RptgTp>TWOS</RptgTp>
  <Pairg>PARD</Pairg>
  <Rcncltn>RECO</Rcncltn>
  <ValtnRcncltn>NOAP</ValtnRcncltn>
  <Rvvd>false</Rvvd>
  <FrthrMod>false</FrthrMod>
</RptgRqrmnt>
```

Po zmianach będą możliwe 3 wartości:

NREC – gdy wartość przynajmniej jednego możliwego do uzgodnienia pola z sekcji wyceny nie mieści się w dopuszczalnych tolerancjach.

NOAP – nie dotyczy

RECO – gdy wartości wszystkich możliwych do uzgodnienia pól z sekcji wyceny mieszczą się w dopuszczalnych tolerancjach.

Sekcja **<MtchgCrit>** może zawierać różnice w uzgodnieniu większej ilości pól niż dotychczas (**148 vs 87**).

Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - zmiany w raportach

Zmiany w raportach End-of-Day **DATTSR**

Dotychczas sekcja <**RcncltnFlg**> była wypełniana jedną z wartości :
NORE, SSNE, SSUN, SSPA, SSMA, DSNM, DSMA

Po zmianach możliwe będą również poniższe flagi:

- **SPRW** - Single Sided EEA Partially Reconciled No Valuation Reconciliation.
- **SPRV** - Single Sided EEA Partially Reconciled Valuation Reconciliation Only.
- **DPRW** - Dual Sided EEA Partially Reconciled No Valuation Reconciliation.
- **DPRV** - Dual Sided EEA Partially Reconciled Valuation Reconciliation Only.

Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - zmiany w raportach

Powiązanie flag z DATTSR ze statusami w raporcie DATREC

DATTSR	DATREC <RptgTp>/<Paigr>/<Rcncltn>/<ValtnRcncltn>
Dual Sided EEA Partially Reconciled – No Valuation Reconciliation (DPRW)	TWOS/PARD/RECO/NREC
Dual Sided EEA Partially Reconciled – Valuation Reconciliation Only (DPRV)	TWOS/PARD/NREC/RECO
Dual Sided Matched (DSMA)	TWOS/PARD/RECO/RECO TWOS/PARD/RECO/NOAP
Dual Sided Non-Matched (DSNM)	TWOS/PARD/NREC/NREC TWOS/PARD/NREC/NOAP
Single Sided EEA Matched (SSMA)	SWOS/PARD/RECO/RECO SWOS/PARD/RECO/NOAP
Single Sided EEA Paired (SSPA)	SWOS/PARD/NREC/NREC SWOS/PARD/NREC/NOAP
Single Sided EEA Partially Reconciled – No Valuation Reconciliation (SPRW)	SWOS/PARD/RECO/NREC
Single Sided EEA Partially Reconciled – Valuation Reconciliation Only (SPRV)	SWOS/PARD/NREC/RECO
Single Sided EEA Unpaired (SSUN)	SWOS/UNPR/NREC/NREC SWOS/UNPR/NREC/NOAP

Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - rekonyliacja wyceny

Przy określaniu statusów w raporcie DATREC sekcje **<Rcncltn>** i **<ValtnRcncltn>** traktowane są rozłącznie.

<ValtnRcncltn> to 4 pola z *Sekcji 2c – Valuation* Tabeli walidacyjnej:

- 2.21 Valuation amount;
- 2.22 Valuation currency;
- 2.24 Valuation method;
- 2.25 Delta.

```
<RptgRqrmnt>  
  <RptgTp>TWOS</RptgTp>  
  <Pairg>PARD</Pairg>  
  <Rcncltn>RECO</Rcncltn>  
  <ValtnRcncltn>NOAP</ValtnRcncltn>  
  <Rvvd>>false</Rvvd>  
  <FrthrMod>>false</FrthrMod>  
</RptgRqrmnt>
```

<Rcncltn> to pozostałe 144 pola.

Możliwa jest sytuacja gdy **<ValtnRcncltn>** otrzyma status NREC a **<Rcncltn>** status RECO.

Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - rekonyliacja wyceny

Do rekonyliacji wyceny mogą przystąpić jedynie te transakcje, które:

- spełniają warunki wejścia do procesu rekonyliacji oraz
- żadna ze stron nie jest wykluczona z rekonyliacji wyceny.

Wyłączenia:

- gdy jedną ze stron jest podmiot podmiot NFC-;
- kontrakty zawarte na rynku regulowanym (ETD) raportowane po poziomie transakcji (Level = "TCTN");
- kontrakty, gdzie Execution timestamp = Expiration date;
- kontrakty, gdzie Execution timestamp = Early termination date;
- zgłoszenia z AT=POSC.

Nawet jeśli podmiot, mimo braku obowiązku, przekaże dane dotyczące wyceny, zostaną one pominięte w procesie rekonyliacji.

Powyższe przypadki zostaną oznaczone w raporcie DATREC jako <ValtnRcncltn> „*Not applicable*” (NOAP).

Rekonyliacji za każdym razem podlegać będzie **pełen zestaw pól**, nie tylko pola wyceny.

Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - rekonyliacja wyceny

W procesie rekonyliacji zostanie sprawdzone czy :

1. wartości bezwzględne wycen podanych przez kontrahentów mieszczą się w zakresie dostępnej tolerancji :
 - "CCPV"- zaokrąglenie do pełnej wartości;
 - "MTMA"- odchylenie $\pm 2.5\%$ od średniej wartości bezwzględnych podanych wycen;
 - "MTMO"- odchylenie $\pm 5\%$ od średniej wartości bezwzględnych podanych wycen;
 - gdy jeden kontrahent używa MTMA a drugi MTMO - odchylenie $\pm 5\%$ od średniej wartości bezwzględnych podanych wycen .
2. zaraportowane znaki są przeciwne.

Jeśli którykolwiek z powyższych warunków nie zostanie spełniony, różnice wartości zostaną przedstawione w raporcie DATREC a sekcja <ValtnRcncltn > zostanie oznaczona jako „not reconciled” (NREC).

Sekcja <ValtnRcncltn > zostanie oznaczona jako „reconciled” (RECO) tylko, gdy wszystkie 4 pola z sekcji wyceny są uzgodnione.

Section 2a - Identifiers and links

Pola

- Prior UTI (for one-to-one and one-to-many. relations between transactions)
- Subsequent position UTI.

Section 2b - Contract information

Pola

- Derivative based on crypto-assets.
- Indicator of the underlying index.
- Name of the underlying index.
- Custom basket code.
- Identifier of the basket's constituents.
- Settlement currency 1.
- Settlement currency 2.

Section 2g - Details on the transaction

Pola

- Unadjusted effective date of the price.
- Unadjusted end date of the price.
- Price in effect between the unadjusted effective and end date.
- Package transaction price.
- Package transaction price currency.
- Other payment type.
- Other payment amount.
- Other payment currency.
- Other payment date.
- Other payment payer.
- Other payment receiver.

Section 2h - Interest Rates

Pola

- Spread of leg 1.
- Spread currency of leg 1.
- Spread of leg 2.
- Spread currency of leg 2.
- Package transaction spread.
- Package transaction spread currency.

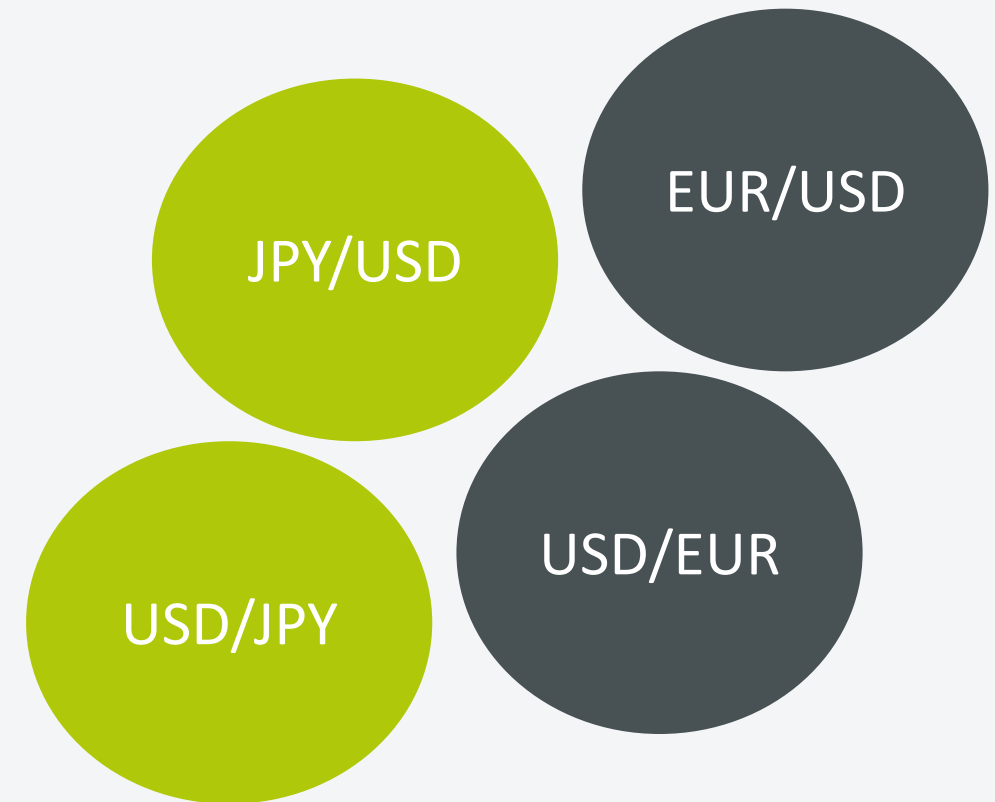


Section 2i - Foreign Exchange

Pola

- Exchange rate 1.
- Forward exchange rate.
- Exchange rate basis.

Przy podaniu kursów „odwróconych” repozytorium będzie brało pod uwagę taką możliwość.



Proces rekonyliacji - II faza wdrożenia - pozostałe sekcje

Section 2j - Commodities and emission allowances (General)

Pola

- Base product
- Sub-product
- Further sub-product

Section 2k - Commodities and emission allowances (Energy)

Pola

- Delivery point or zone.
- Interconnection Point.
- Load type.
- Delivery interval start time.
- Delivery interval end time.
- Delivery start date.
- Delivery end date.
- Duration.
- Days of the week.
- Delivery capacity.
- Quantity Unit.
- Price/time interval quantity.
- Currency of the price/time interval quantity.

Section 2l - Options

Pola

- Strike price.
- Effective date of the strike price.
- Strike price in effect on associated effective date.
- Strike price currency/currency pair.
- End date of the strike price.
- Option premium amount.
- Option premium currency.
- Option premium payment date.

Section 2m - Credit derivatives

Pola

- Series.
- Version.
- CDS index attachment point.
- CDS index detachment point

Kontakt

Repozytorium Transakcji EMIR:

email: repository@kdpw.pl

tel: 22 537 94 60



EMIR - TSR krok po kroku. Budowa raportu Trade State

1. Ewa Kosowska, Szef Zespołu ds. Raportowania i Współpracy z Nadzorcami, Dział Repozytorium Transakcji, KDPW
Warszawa, 27 listopada 2025 roku

Spis treści

1. Budowa TSR
2. Studia przypadków
3. Wpływ raportu TSR na reco
4. Zmiany w DATMDS i DATWRN

Dostęp do raportów końca dnia (End of Day)

KDPW_TR EMIR udostępnia uczestnikom informacje dotyczące zgłoszonych transakcji na instrumentach pochodnych w formacie XML zgodnie z ISO 20022.

Dostęp do danych w KDPW_TR udzielany jest zgodnie z obowiązującymi RTS, tj. przysługuje następującym podmiotom:

- a. kontrahentom dokonującym zgłoszeń (Counterparty 1),
- b. podmiotom przekazującym zgłoszenia (RSE),
- c. podmiotom odpowiedzialnym za zgłaszanie (ERR) oraz
- d. osobom trzecim, którym przyznano dostęp do informacji na podstawie art. 78 ust. 7 rozporządzenia (UE) nr 648/2012.

Warunkiem otrzymywania raportów EoD przez podmioty wymienione wyżej jest uczestnictwo w KDPW_TR EMIR w jednym z obowiązujących typów, tj. GUR, ZUR, IUR, PUR lub KUR.

Raporty EoD są udostępniane do godz. 6:00:00 UTC dnia D za poprzedni dzień roboczy (D-1) za pośrednictwem dwóch kanałów komunikacyjnych: GUI EMIR REFIT (online.kdpw.pl) i kanał A2A (opcjonalnie).

Derivatives Trade State Report (TSR) – komunikat typu **auth.107.001.XX**:

- wysyłany w celu udostępnienia informacji zawierających ostatni stan wszystkich aktywnych transakcji na dany dzień z maksymalnym Event Date jeden dzień wcześniejszym od dnia obowiązywania raportu (tj. as of date). TSR wysłany w dniu D ze stanem na dzień D-1 i uwzględniającym wszystkie AT wysłane do tego dnia zawiera dane z maksymalnym Event Date D-2;
- przykładowa nazwa pliku TSR:

R001_DATTSR_RZ90_ENDDAY-251118_001001-20251119005324.xml.gz.



Obowiązywanie stanu transakcji:

- stan transakcji na dzień Event Date D-2 obowiązuje w kolejnych dniach, do jej wygaśnięcia lub zmiany;
- może zostać zmieniony tylko przez raporty modyfikujące (CORR, MODI, REVI, VALU);
- ostatni Event Date, na który można zarejestrować zmianę, to dzień wygaśnięcia transakcji.

Wygaśnięcie transakcji:

- Expiration Date – transakcja na dzień Event Date = Expiration Date umieszczana jest w TSR;
- Early Termination Date – transakcja na dzień Event Date = Early Termination Date nie jest umieszczana w TSR.

Przykład:

Transakcja z Expiration Date = 2025-11-17 pojawi się w TSR wygenerowanym w dniu 19 listopada z as of date 18 listopada.

Transakcja z Early Termination Date = 2025-11-17 nie pojawi się w TSR w dniu 19 listopada z as of date 18 listopada.

Budowa TSR – case study 1

Raportowanie zmian w historii transakcji

Historia raportowania transakcji:

UTI history

Filters

UTI

Counterparty 1 (Reporting counterparty)

Counterparty 2

Level

Execution timestamp from

Execution timestamp to

Date from

Clear

Search

UTI	Counterparty 1 (Reporting counterparty)	Counterparty 2	Level	Execution date	Date from	Date to
259400EMIRDEMOGUR006TESTEODDATTSR	259400L3KBYEVNHEJF55	259400EMIRDEMOGUR006	T	2025-10-01 00:00:00	2025-10-01	2025-12-23

Budowa TSR – case study 1

Raportowanie zmian w historię transakcji

Historia raportowania transakcji wg kolejności raportowania i przyjęcia do RT.

Została zgłoszona nowa transakcja (NEWT)

Event date	Action type	↑ Reporting date time	Valuation date time	Receive date time
2025-10-01	New	2025-11-12 06:00:00		2025-11-12 17:59:08

Budowa TSR – case study 1

Raportowanie zmian w historii transakcji

Widok raportu TSR po złożeniu raportu o nowej transakcji:

Data wygenerowania – 2025-11-13

As of date – 2025-11-12

<XprtnDt>2025-12-13</XprtnDt>

Event Date – 2025-10-01

```
<Stat><CtrPtySpecfcData><CtrPty><RptgCtrPty><Id><Lgl><Id><LEI>259400L3KBYEVNHEJF55</LEI></Id></Lgl></Id><Ntr><CntrlCntrPty>NORE
</CntrlCntrPty></Ntr><DrctnOrSd><Drctn><DrctnOfTheFrstLeg>MAKE</DrctnOfTheFrstLeg><DrctnOfTheScndLeg>TAKE
</DrctnOfTheScndLeg></Drctn></DrctnOrSd></RptgCtrPty><OthrCtrPty><IdTp><Lgl><Id><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Id></Lgl></IdTp><Ntr><FI><Sctr><Cd>CSDS</Cd></Sctr><ClrThrshld>true
</ClrThrshld></FI></Ntr><RptgOblgtn>true</RptgOblgtn></OthrCtrPty><Brkr><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Brkr><SubmitgAgt><LEI>259400EMIRDEMOGUR006
</LEI></SubmitgAgt><ClrMmb><Lgl><Id><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Id></Lgl></ClrMmb><NttyRspnsblForRpt><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></NttyRspnsblForRpt></CtrPty><RptgTmStmp>
2025-11-12T06:00:00Z</RptgTmStmp></CtrPtySpecfcData><CmonTradData><CtrctData><CtrctTp>FORW</CtrctTp><AsstClss>CURR</AsstClss><PdctClssfctn>FFVCSX</PdctClssfctn><PdctId><ISIN>
XC0009659910</ISIN></PdctId><UndrlygInstrm><ISIN>XC0009659910</ISIN></UndrlygInstrm><SttlmCcy><Ccy>JPY</Ccy></SttlmCcy><SttlmCcyScndLeg><Ccy>JPY
</Ccy></SttlmCcyScndLeg><DerivBasedOnCrptAsst>true</DerivBasedOnCrptAsst></CtrctData><TxData><TxId><UnqTxIdr>259400EMIRDEMOGUR006TESTEODDATTSR
</UnqTxIdr></TxId><CollPrftlCd><Prftl><Cd>RANDOM</Cd></Prftl></CollPrftlCd><PltfmIdr>XXXX</PltfmIdr><TxPric><Pric><MntryVal><Amt Ccy="JPY">987654321.12345
</Amt></MntryVal></Pric></TxPric><NtnlAmt><FrstLeg><Amt><Amt Ccy="JPY">987654321</Amt></FrstLeg><ScndLeg><Amt><Amt Ccy="JPY">987654321
</Amt></ScndLeg></NtnlAmt><NtnlQty><FrstLeg><TtlQty>1</TtlQty><Dtls><SchdlPrd><Qty>1</Qty><UadjstdFctvDt>2025-10-01
</UadjstdFctvDt></SchdlPrd></Dtls></FrstLeg><ScndLeg><TtlQty>1</TtlQty><Dtls><SchdlPrd><Qty>1</Qty><UadjstdFctvDt>2025-10-01
</UadjstdFctvDt></SchdlPrd></Dtls></ScndLeg></NtnlQty><DlvryTp>CASH</DlvryTp><ExctnTmStmp>2025-10-01T00:00:00Z</ExctnTmStmp><FctvDt>2025-10-01</FctvDt><XprtnDt>2025-12-13
</XprtnDt><SttlmDt>2025-10-01</SttlmDt><MstrAgrmt><Tp><Tp>BIAG</Tp></Tp><Vrsn>2023</Vrsn></MstrAgrmt><PstTradRskRdctnFlg>false</PstTradRskRdctnFlg><DerivEvt><Tp>TRAD
</Tp><TmStmp><Dt>2025-10-01</Dt></TmStmp></DerivEvt><TradClr><ClrOblgtn>UKWN</ClrOblgtn><ClrSts><Clrd><Dtls><CCP><LEI>2594000K576D5CQXI987</LEI></CCP><ClrDtTm>2025-10-01T16:04:46Z
</ClrDtTm></Dtls></Clrd></ClrSts><IntraGrp>false</IntraGrp></TradClr><Ccy><XchgRate>150.475</XchgRate><XchgRateBsis><CcyPair><BaseCcy>USD</BaseCcy><QtdCcy>JPY
</QtdCcy></CcyPair></XchgRateBsis></Ccy></TxData><CtrctMod><ActnTp>NEWT</ActnTp><Lvl>TCTN</Lvl></CtrctMod></CmonTradData></Stat>
```

Budowa TSR – case study 1

Raportowanie zmian w historię transakcji

Uczestnik w dniu 13 listopada 2025 modyfikuje datę wygaśnięcia transakcji z 13 grudnia 2025 na 23 grudnia 2025 przysyłając AT=MODI.

↑ Event date	Action type	Reporting date time	Valuation date time	Receive date time
2025-10-01	New	2025-11-12 06:00:00		2025-11-12 17:59:08
2025-10-31	Mod	2025-11-13 06:00:00		2025-11-13 16:44:35

Budowa TSR – case study 1

Raportowanie zmian w historii transakcji

Widok raportu TSR po złożeniu modyfikacji danych do transakcji:

Data wygenerowania – 2025-11-14

As of date – 2025-11-13

<XprtnDt>2025-12-23</XprtnDt>

Event Date – 2025-10-31

```
<Stat><CtrPtySpfcData><CtrPty><RptgCtrPty><Id><Lgl><Id><LEI>259400L3KBYEVNHEJF55</LEI></Id></Lgl></Id><Ntr><CntrlCntrPty>NORE
</CntrlCntrPty></Ntr><DrctnOrSd><Drctn><DrctnOfTheFrstLeg>MAKE</DrctnOfTheFrstLeg><DrctnOfTheScndLeg>TAKE
</DrctnOfTheScndLeg></Drctn><DrctnOrSd><RptgCtrPty><OthrCtrPty><IdTp><Lgl><Id><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Id></Lgl></IdTp><Ntr><FI><Sctr><Cd>CSDS</Cd></Sctr><ClrThrshld>true
</ClrThrshld></FI></Ntr><RptgOblgtn>true</RptgOblgtn></OthrCtrPty><Brkr><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Brkr><SubmitgAgt><LEI>259400EMIRDEMOGUR006
</LEI></SubmitgAgt><ClrMmb><Lgl><Id><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Id></Lgl></ClrMmb><NttyRspnsblForRpt><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></NttyRspnsblForRpt></CtrPty><RptgTmStmp>
2025-11-13T06:00:00Z</RptgTmStmp></CtrPtySpfcData><CmonTradData><CtrctData><CtrctTp>FORW</CtrctTp><AsstClss>CURR</AsstClss><PdctClssfctn>FFVCSX</PdctClssfctn><PdctId><ISIN>
XC0009659910</ISIN></PdctId><UndrlygInstrm><ISIN>XC0009659910</ISIN></UndrlygInstrm><SttlmCcy><Ccy>JPY</Ccy></SttlmCcy><SttlmCcyScndLeg><Ccy>JPY
</Ccy></SttlmCcyScndLeg><DerivBasedOnCrptAsst>true</DerivBasedOnCrptAsst></CtrctData><TxData><TxId><UnqTxId>259400EMIRDEMOGUR006TESTEODDATSR
</UnqTxId></TxId><CollPrtflCd><Prtfl><Cd>RANDOM</Cd></Prtfl></CollPrtflCd><PltfmId>XXXX</PltfmId><TxPric><Pric><MntryVal><Amt Ccy="JPY">987654321.12345
</Amt></MntryVal></Pric></TxPric><NtnlAmt><FrstLeg><Amt><Amt Ccy="JPY">987654321</Amt></Amt></FrstLeg><ScndLeg><Amt><Amt Ccy="JPY">987654321
</Amt></Amt></ScndLeg><NtnlAmt><NtnlQty><FrstLeg><TtlQty>1</TtlQty><Dtls><SchdlPrd><Qty>1</Qty><UadjstdFctvDt>2025-10-01
</UadjstdFctvDt></SchdlPrd><Dtls></FrstLeg><ScndLeg><TtlQty>1</TtlQty><Dtls><SchdlPrd><Qty>1</Qty><UadjstdFctvDt>2025-10-01
</UadjstdFctvDt></SchdlPrd><Dtls></ScndLeg><NtnlQty><DlvryTp>CASH</DlvryTp><ExctnTmStmp>2025-10-01T00:00:00Z</ExctnTmStmp><FctvDt>2025-10-01</FctvDt><XprtnDt>2025-12-23
</XprtnDt><SttlmDt>2025-10-01</SttlmDt><MstrAgrmt><Tp><Tp>BIAG</Tp></Tp><Vrsn>2023</Vrsn></MstrAgrmt><PstTradRskRdctnFlg>false</PstTradRskRdctnFlg><DerivEvt><Tp>TRAD
</Tp><TmStmp><Dt>2025-10-31</Dt></TmStmp></DerivEvt><TradClr><ClrOblgtn>UKWN</ClrOblgtn><ClrSts><Clrd><Dtls><CCP><LEI>2594000K576D5CQXI987</LEI></CCP><ClrDtTm>2025-10-01T16:04:46Z
</ClrDtTm></Dtls></Clrd></ClrSts><IntraGrp>false</IntraGrp></TradClr><Ccy><XchgRate>150.475</XchgRate><XchgRateBsis><CcyPair><BaseCcy>USD</BaseCcy><QtdCcy>JPY
</QtdCcy></CcyPair></XchgRateBsis></Ccy></TxData><CtrctMod><ActnTp>MODI</ActnTp><Lvl>TCTN</Lvl></CtrctMod></CmonTradData><TechAttrbts><RcncltnFlg>SSUN
</RcncltnFlg></TechAttrbts></Stat>
```

Budowa TSR – case study 1

Raportowanie zmian w historii transakcji

Raport korekty (AT=CORR) z datą Event Date wcześniejszą niż podana w modyfikacji (AT=MODI):

```
<ExctnTmStmp>2025-10-01T00:00:00Z</ExctnTmStmp>
```

```
<FctvDt>2025-10-01</FctvDt>
```

```
<XprtnDt>2025-12-31</XprtnDt>
```

```
<SttlmDt>2025-10-01</SttlmDt>
```

```
<MstrAgrmt>
```

```
  <Tp>
```

```
    <Tp>BIAG</Tp>
```

```
  </Tp>
```

```
  <Vrsn>2023</Vrsn>
```

```
</MstrAgrmt>
```

```
<PstTradRskRdctnFlg>false</PstTradRskRdctnFlg>
```

```
<DerivEvt>
```

```
  <TmStmp>
```

```
    <Dt>2025-10-30</Dt>
```

```
  </TmStmp>
```

```
</DerivEvt>
```

Budowa raportu Trade State Report – Case study 1

Raportowanie zmian w historii transakcji

Do przygotowania raportu TSR system KDPW_TR EMIR "układa" zgłoszone raporty według daty **Event Date**.

↑ Event date	Action type	Reporting date time	Valuation date time	Receive date time
2025-10-01	New	2025-11-12 06:00:00		2025-11-12 17:59:08
2025-10-30	Crrctn	2025-11-14 06:00:00		2025-11-14 15:54:19
2025-10-31	Mod	2025-11-13 06:00:00		2025-11-13 16:44:35

Expiration Date

2025-12-13

2025-12-31

2025-12-23

Budowa TSR - case study 1

Raportowanie zmian w historii transakcji

Widok raportu TSR po złożeniu korekty danych do transakcji (AT=CORR):

Data wygenerowania – 2025-11-15

As of date – 2025-11-14

<XprtnDt>2025-12-23</XprtnDt>

Event Date – 2025-10-31

```
<Stat><CtrPtySpfcData><CtrPty><RptgCtrPty><Id><Lgl><Id><LEI>259400L3KBYEVNHEJF55</LEI></Id></Lgl></Id><Ntr><CntrlCntrPty>NORE
</CntrlCntrPty></Ntr><DrctnOrSd><Drctn><DrctnOfTheFrstLeg>MAKE</DrctnOfTheFrstLeg><DrctnOfTheScndLeg>TAKE
</DrctnOfTheScndLeg></Drctn></DrctnOrSd></RptgCtrPty><OthrCtrPty><IdTp><Lgl><Id><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Id></Lgl></IdTp><Ntr><FI><Sctr><Cd>CSDS</Cd></Sctr><ClrThrshld>true
</ClrThrshld></FI></Ntr><RptgOblgtn>true</RptgOblgtn></OthrCtrPty><Brkr><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Brkr><SubmitgAgt><LEI>259400EMIRDEMOGUR006
</LEI></SubmitgAgt><ClrMmb><Lgl><Id><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></Id></Lgl></ClrMmb><NttyRspnsblForRpt><LEI>259400EMIRDEMOGUR006</LEI></NttyRspnsblForRpt></CtrPty><RptgTmStmp>
2025-11-13T06:00:00Z</RptgTmStmp></CtrPtySpfcData><CmonTradData><CtrctData><CtrctTp>FORW</CtrctTp><AsstClss>CURR</AsstClss><PdctClssfctn>FFVCSX</PdctClssfctn><PdctId><ISIN>
XC0009659910</ISIN></PdctId><UndrlygInstrm><ISIN>XC0009659910</ISIN></UndrlygInstrm><SttlmCcy><Ccy>JPY</Ccy></SttlmCcy><SttlmCcyScndLeg><Ccy>JPY
</Ccy></SttlmCcyScndLeg><DerivBasedOnCrptAsst>true</DerivBasedOnCrptAsst></CtrctData><TxData><TxId><UnqTxIdr>259400EMIRDEMOGUR006TESTEODDATTSR
</UnqTxIdr></TxId><CollPrtflCd><Prtfl><Cd>RANDOM</Cd></Prtfl></CollPrtflCd><PltfmIdr>XXXX</PltfmIdr><TxPric><Pric><MntryVal><Amt Ccy="JPY">987654321.12345
</Amt></MntryVal></Pric></TxPric><NtnlAmt><FrstLeg><Amt><Amt Ccy="JPY">987654321</Amt></Amt></FrstLeg><ScndLeg><Amt><Amt Ccy="JPY">987654321
</Amt></Amt></ScndLeg></NtnlAmt><NtnlQty><FrstLeg><TtlQty>1</TtlQty><Dtls><SchdlPrd><Qty>1</Qty><UadjstdFctvDt>2025-10-01
</UadjstdFctvDt></SchdlPrd></Dtls></FrstLeg><ScndLeg><TtlQty>1</TtlQty><Dtls><SchdlPrd><Qty>1</Qty><UadjstdFctvDt>2025-10-01
</UadjstdFctvDt></SchdlPrd></Dtls></ScndLeg></NtnlQty><DlvryTp>CASH</DlvryTp><ExctnTmStmp>2025-10-01T00:00:00Z</ExctnTmStmp><FctvDt>2025-10-01</FctvDt><XprtnDt>2025-12-23
</XprtnDt><SttlmDt>2025-10-01</SttlmDt><MstrAgrmt><Tp><Tp>BIAG</Tp></Tp><Vrsn>2023</Vrsn></MstrAgrmt><PstTradRskRdctnFlg>false</PstTradRskRdctnFlg><DerivEvt><Tp>TRAD
</Tp><TmStmp><Dt>2025-10-31</Dt></TmStmp></DerivEvt><TradClr><ClrOblgtn>UKWN</ClrOblgtn><ClrSts><Clrd><Dtls><CCP><LEI>2594000K576D5CQXI987</LEI></CCP><ClrDtTm>2025-10-01T16:04:46Z
</ClrDtTm></Dtls></Clrd></ClrSts><IntraGrp>false</IntraGrp></TradClr><Ccy><XchgRate>150.475</XchgRate><XchgRateBsis><CcyPair><BaseCcy>USD</BaseCcy><QtdCcy>JPY
</QtdCcy></CcyPair></XchgRateBsis></Ccy></TxData><CtrctMod><ActnTp>MODI</ActnTp><Lvl>TCTN</Lvl></CtrctMod></CmonTradData><TechAttrbts><RcncltnFlg>SSUN
</RcncltnFlg></TechAttrbts></Stat>
```

Budowa TSR – case study 2

Raportowanie transakcji jednodniowych

Transakcje, które zostały zawarte i sterminowane tego samego dnia nie pojawią się w raporcie TSR.

W raporcie TSR wygenerowanym w dniu 19 listopada 2025 transakcja nie zostanie uwzględniona.

Event date	Action type	↑ Reporting date time	Valuation date time	Receive date time
2025-11-17	New	2025-11-18 20:00:00		2025-11-18 22:45:53
2025-11-17	Termntn	2025-11-18 21:30:47		2025-11-18 22:46:45

Budowa TSR – case study 3

Raportowanie składowych pozycji

Position component (AT=POSC) nie pojawiają się w raporcie TSR. Każdy AT=POSC musi być przypisany do otwartej pozycji, która znajduje się w raporcie TSR.

UTI	Counterparty 1 (Reporting co...	Counterparty 2	Level	Execution date	Date from	Date to
259400EMIRDEMOGUR006POSCCOMPTEST7	259400EMIRDEMOGUR006	259400L3KBYEVNHEJF55	T	2025-10-16 07:30:00	2025-10-16	

Budowa TSR – case study 4

Anulowanie transakcji

W przypadku anulowania transakcji (AT=EROR) w aplikacji w zakładce „UTI history” zostanie ona zaznaczona kolorem czerwonym.

UTI		Counterparty 1 (Reporting ...	Counterparty 2	Level	Execution date	Date from	Date to	
259400ASZUS000000046TE STMANTISA14600V220102025		259400ASZUS0000000046	213800I1WA9QMO2WXS84	T	2025-05-14 10:00:00	2025-05-14	2035-07-01	...

Event date	Action type	↑ Reporting date time	Valuation date time	Receive date time
2025-05-14	New	2025-10-20 01:00:00		2025-10-20 16:34:10
2025-10-21	Err	2025-10-21 02:00:00		2025-10-21 11:20:45

Po anulowaniu transakcji przez raportującego jest ona natychmiast oznaczana jako nieistniejąca i nie będzie prezentowana w raporcie TSR już od pierwszego raportu generowanego po dniu otrzymania AT=EROR.

Budowa TSR – case study 5

Wznowienie transakcji (AT=REVI)

Pozycja, która wygała w dniu 2025-07-14 została „ożywiona” w dniu 2025-11-14 i otrzymała nową datę Expiration Date 2026-09-14.

Transakcja pojawi się w raporcie TSR wygenerowanym w dniu 2025-11-18:

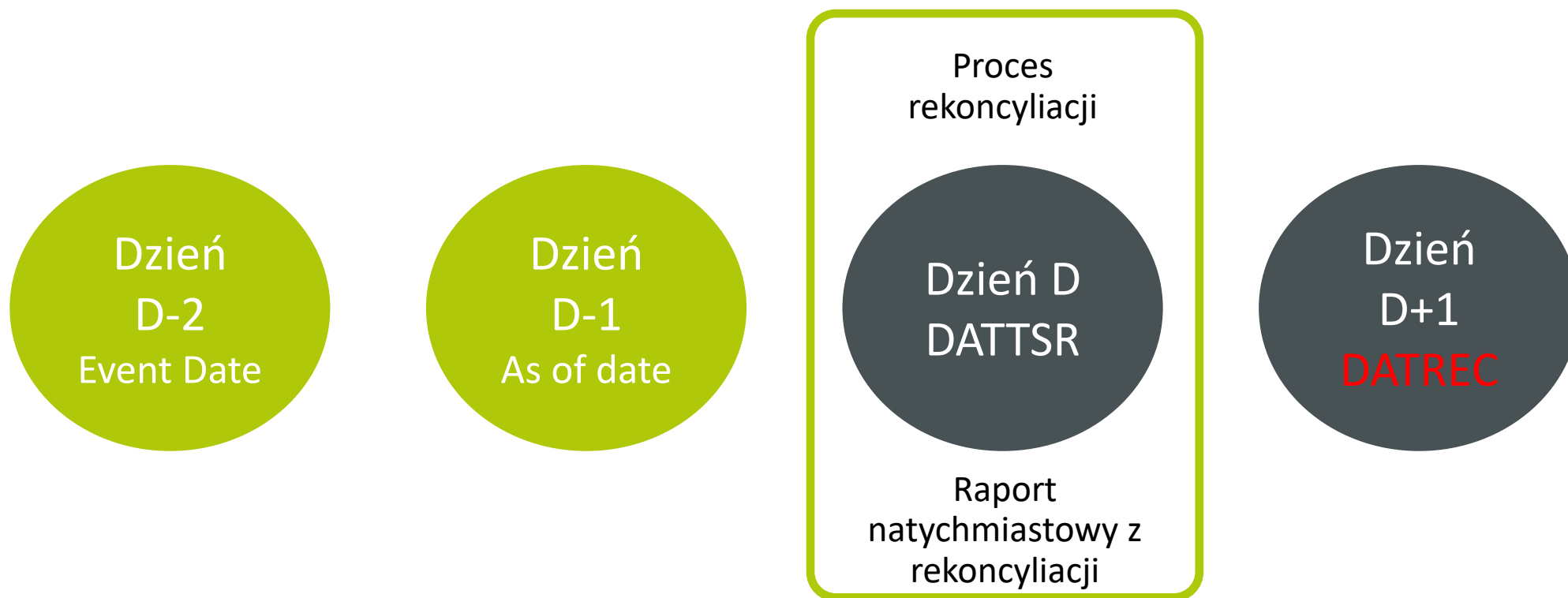
UTI	Counterparty 1 (Reporting ...	Counterparty 2	Level	Execution date	Date from	Date to
259400RFGUR000000013259400JMZUR0000000811141145615	259400RFGUR000000013	259400JMZUR000000008	P	2025-07-14 00:00:00	2025-07-14	2025-07-14

↑ Event date	Action type	Reporting date time	Valuation date time	Receive date time
2025-07-14	New	2025-11-14 09:45:42		2025-11-14 10:45:56
2025-11-14	Rvw	2025-11-14 09:45:42		2025-11-14 10:45:56

Budowa TSR – wpływ na raport DATREC

Raport TSR – największy wpływ na proces rekonyliacji i raport DATREC.

Proces rekonyliacji bierze pod uwagę ostatni stan transakcji z dnia D-2 (identycznie jak TSR) jednak raport End of Day DATREC powstaje dopiero kolejnego dnia ze względu na konieczność wymiany danych z pozostałymi repozytoriami.



Budowa DATMDS (Margin State) i DATWRN (Warnings)

KDPW planuje zmiany w budowie raportów DATMDS i DATWRN.

1. DATMDS

W raporcie DATMDS auth.109.001.xx stan margina prezentowany będzie **jednokrotnie** dla każdego klucza CP1 – CP2 - Portfolio Code, tj.:

- pole UTI nie będzie wypełniane (margin nie będzie duplikowany dla poszczególnych transakcji/UTI);
- w przypadku wielu transakcji powiązanych z tym samym portfelem, **raport zawierać będzie wyłącznie jeden rekord margina reprezentujący ten portfel.**

2. DATWRN

- w sekcji missing valuation <MssngValtn> oraz missing margin <MssngMrgnInf> nie będą wskazywane transakcje jednodniowe, gdzie Execution Date = Expiration Date.

Kontakt

Repozytorium Transakcji EMIR:

email: repository@kdpw.pl

tel: 22 537 94 60

