

CCP/ZW/275/2023

Warszawa, 29 marca 2023 r.

Uczestnicy KDPW_CCP
(obrót zorganizowany)

Szanowni Państwo,

w nawiązaniu do pisma z dnia 4 października 2022 r. o numerze CCP/ZW/655/2022 dotyczącego zmian w systemach informatycznych KDPW i KDPW_CCP zaplanowanych na 2023 r., przekazujemy w załączeniu szczegółową specyfikację zmian planowanych do wprowadzenia w ramach dostosowania systemów GK KDPW do nowego systemu transakcyjnego WATS.

Zidentyfikowane zmiany dotyczą komunikatów ISO20022 z obszaru Securities Clearing (secl) i polegają na aktualizacji do obowiązującej obecnie wersji standardu Clearing 3.0, dodaniu standardowej koperty komunikacyjnej KDPW stosowanej dla innych grup komunikatów, a także poszerzeniu zawartości informacyjnej komunikatów w sposób opisany szczegółowo w załączonym dokumencie.

Ponadto, chcielibyśmy poinformować, że nie planujemy i obecnie nie identyfikujemy innych zmian w pozostałych obszarach wymiany danych pomiędzy GK KDPW i uczestnikami, wynikającymi z dostosowywania systemów GK KDPW do nowego systemu transakcyjnego WATS.

O terminie udostępnienia nowych wersji komunikatów w środowisku testowym informujemy w odrębnej korespondencji.

Z poważaniem,

Żaneta Skorupska-Świrska
Zastępca Dyrektora Zarządzającego KDPW_CCP S.A.

Załącznik:

- Zasady wymiany komunikatów ISO20022 w systemie kdpw_stream w obszarze: Clearing.

Zasady wymiany komunikatów ISO20022 w systemie kdpw_stream

Obszar: Clearing

Wersja 4.0

Warszawa, marzec 2023 r.

Zawartość

1. Historia zmian	3
2. Wstęp	4
3. Podsumowanie zmian ogłoszonych w 2023 r.	4
4. Przepływy komunikatów	5
4.1 Opis przepływów komunikatów ISO20022 – rozliczenia w KDPW_CCP	5
4.2 Opis przepływów komunikatów ISO20022 – procedura odkupu papierów wartościowych w celu likwidacji zawieszenia (procedura ZOR)	6
4.3 Zachowanie wstecznej zgodności – pozostawienie dotychczasowych typów komunikatów	7
5. Szczegółowe zagadnienia związane z budową komunikatów	8
5.1 Stronicowanie raportów	8
5.2 Nagłówek komunikatu: head.001.001.02 — Business Application Header i koperta techniczna	9
6. Opis zawartości komunikatów	12
6.1 Potwierdzenie przyjęcia transakcji: secl.001.001.03 — Trade Leg Notification	12
6.2 Potwierdzenie usunięcia transakcji: secl.002.001.03 — Trade Leg Cancellation	15
6.3 Zestawienie zawartych transakcji: secl.003.001.03 — Trade Leg Statement	17
6.4 Zestawienie pozycji rozliczeniowych netto: secl.004.001.03 — Net Positions Report	19
6.5 Zestawienie zobowiązań rozrachunkowych: secl.010.001.03 — Settlement Obligations Report	22
6.6 Powiadomienie o procedurze odkupu papierów wartościowych: secl.007.001.03 — BuyInNotification	24
6.7 Powiadomienie o realizacji procedury odkupu papierów wartościowych: secl.009.001.03 — BuyInConfirmation	26
6.8 Odroczenie procedury odkupu papierów wartościowych: secl.008.001.03 — BuyInResponse	28

1. Historia zmian

29.03.2023	KDPW_CCP
Wersja 4.0	Dostosowanie do standardu SWIFT w wersji „Clearing 3.0”. Wprowadzenie obsługi koperty technicznej.
02.06.2021	KDPW_CCP
Wersja 3.1	Uzupełnienie komunikatów buy-in o atrybuty związane z wymogami SD_CSDR
3.11.2014	
Wersja 3.0	Dodanie komunikatów do obsługi BISO: secl.007.01.02 i secl.009.01.02
22.02.2013	
wersja 2.2	Aktualizacja przestrzeni nazw (namespace) w przykładach - dostosowanie do wartości stosowanej w wersji „Clearing 2.0”: ‘ <i>urn:iso:std:iso:20022:tec</i> ’
	Komunikat secl.004.01.02: pole <i>TradDt</i> zawiera tylko datę bez czasu, usunięcie pola <i>PlcOfTrad</i> z sekcji ogólnej <i>NetPosRpt</i>
3.02.2012	
wersja 2.1	Dostosowanie do standardu SWIFT w wersji: „Clearing 2.0”
1.07.2011	
wersja 2.0	Usunięcie informacji o kodach AMR
25.03.2011	
wersja 1.0	Utworzenie dokumentu

2. Wstęp

Dokument opisuje budowę i zasady przekazywania komunikatów ISO20022 z obszaru Clearing w systemie kdpw_stream.

Opisywany zestaw komunikatów został opracowany przez Swift we współpracy z grupą przedstawicieli CCP oraz instytucji pełniących rolę uczestników rozliczających.

W dokumencie opisano przepływy komunikatów w kontekście procesów KDPW_CCP.

Przedstawiono budowę nagłówka komunikatów ISO20022 — Business Application Header (BAH). Opisano zawartość poszczególnych komunikatów ISO20022 Clearing wykorzystywanych przez system kdpw_stream.

Komunikaty opisane w niniejszej dokumentacji są przekazywane za pomocą systemu wymiany komunikatów (SWI ESDK/ESDI). Dla zainteresowanych instytucji możliwe też będzie przekazywanie komunikatów ISO20022 za pośrednictwem sieci Swift FINplus.

Dodatkowe informacje na temat budowy komunikatów ISO20022 wraz ze szczegółową specyfikacją techniczną można znaleźć na stronach internetowych: www.iso20022.org oraz www.swift.com.

Schematy komunikatów w postaci plików XSD wraz z przykładami zamieszczono na platformie MyStandards w sekcji poświęconej KDPW_CCP dostępnej pod adresem:

https://www2.swift.com/mystandards/#/group/KDPW_Group/KDPW_CCP

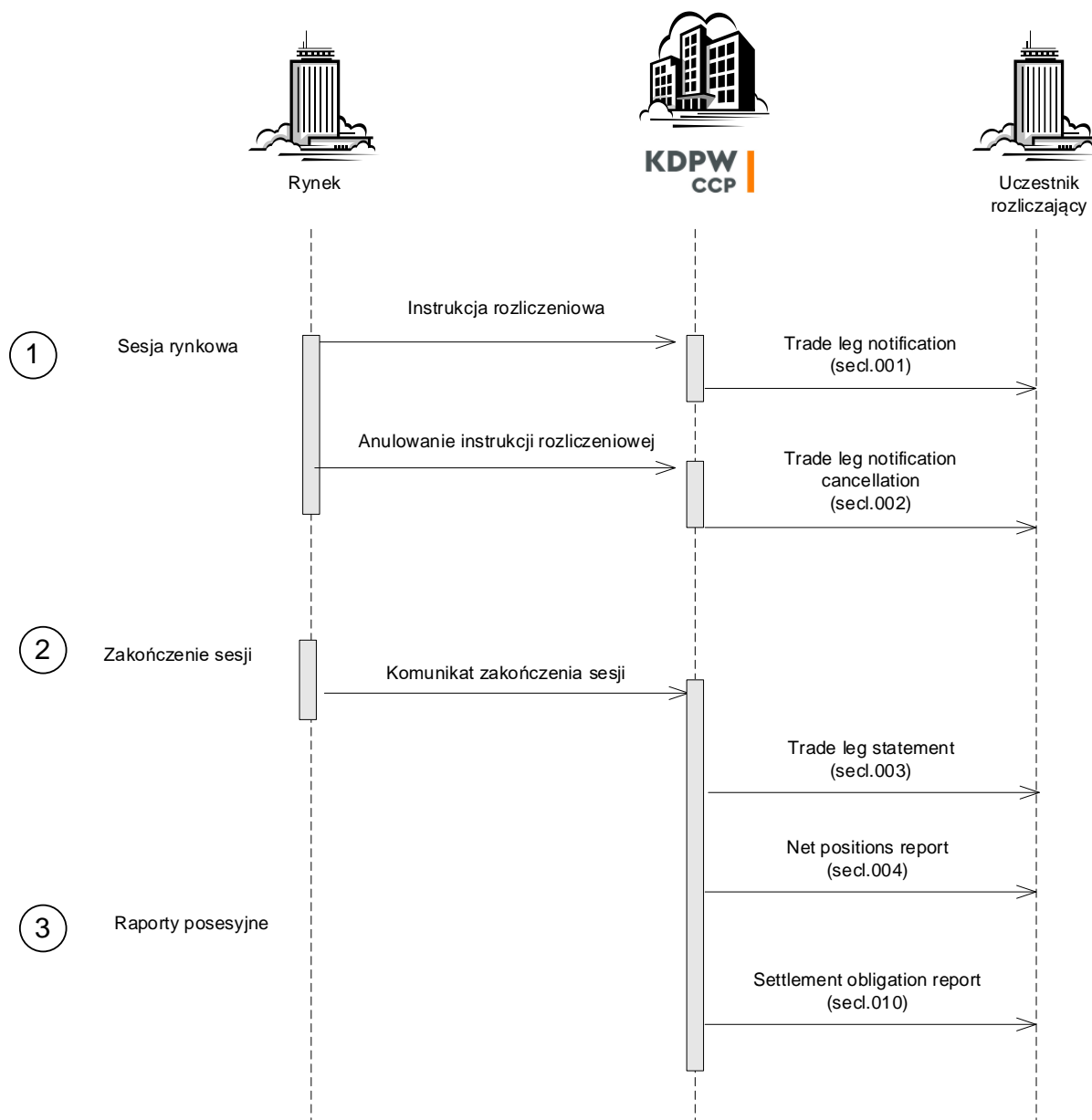
3. Podsumowanie zmian ogłoszonych w 2023 r.

- Wprowadzenie komunikatów ISO20022 zgodnych ze standardem SWIFT Clearing 3.0. Po wprowadzonej zmianie KDPW_CCP będzie obsługiwał następujące komunikaty z obszaru Clearing:
 - secl.001.001.03
 - secl.002.001.03
 - secl.003.001.03
 - secl.004.001.03
 - secl.007.001.03
 - secl.008.001.03
 - secl.009.001.03
 - secl.010.001.03
- Wprowadzenie nagłówka Business Application Header (BAH) w wersji 2.0.
- Dodanie koperty technicznej <RequestPayload> zgodnej z rozwiązaniem stosowanym w Grupie KDPW.
- Dodanie możliwości przekazania wartości nominalnej dla instrumentów dłużnych. Pola zawierające dane o wolumenie aktywów będą przekazywane w postaci wartości nominalnej <FaceAmt> dla instrumentów dłużnych i w jednostkach dla pozostałych typów instrumentów finansowych <Unit>.
- Daty przygotowania raportów zostaną przedstawione w postaci dnia i godziny. Zmiana dotyczy następujących pól:
 - secl.003.001.03 – <StmntDtAndTm><DtTm>
 - secl.004.001.03 – <RptDtAndTm><DtTm>
 - secl.010.001.03 – <RptDtAndTm><DtTm>

4. Przepływy komunikatów

4.1 Opis przepływów komunikatów ISO20022 – rozliczenia w KDPW_CCP

KDPW_CCP wysyła do uczestników rozliczających następujące komunikaty:



W trakcie sesji uczestnik rozliczający otrzymuje na bieżąco komunikaty o przyjętych transakcjach do rozliczeń za pomocą komunikatów secl.001.001.03. W przypadku anulowania transakcji, uczestnik jest o tym informowany za pomocą komunikatu secl.002.001.03.

Po zakończeniu sesji rynkowej, KDPW_CCP w ramach sesji rozliczeniowej udostępnia uczestnikom rozliczającym raporty w postaci komunikatów:

secl.003.001.03 – zestawienie transakcji z danego dnia;

secl.004.001.03 – wyniki procesu nettingu w danym dniu;

secl.010.001.03 – zestawienie zobowiązań rozrachunkowych.

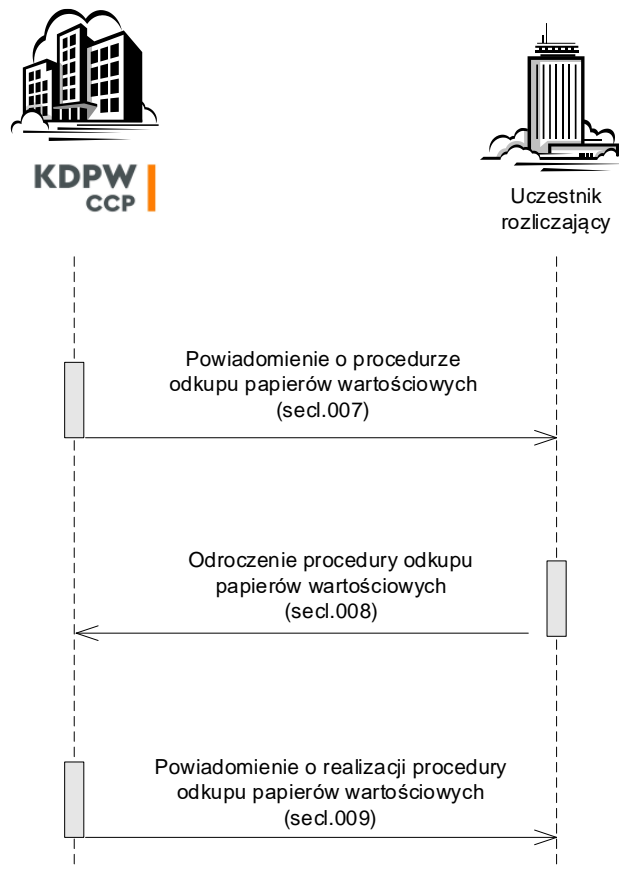
4.2 Opis przepływów komunikatów ISO20022 – procedura odkupu papierów wartościowych w celu likwidacji zawieszenia (procedura ZOR)

W ramach procedury odkupu KDPW_CCP wysyła do uczestników rozliczających następujące komunikaty:

secl.007.001.03 – BuyInNotification – komunikat informujący o rozpoczęciu procedury odkupu papierów wartościowych;

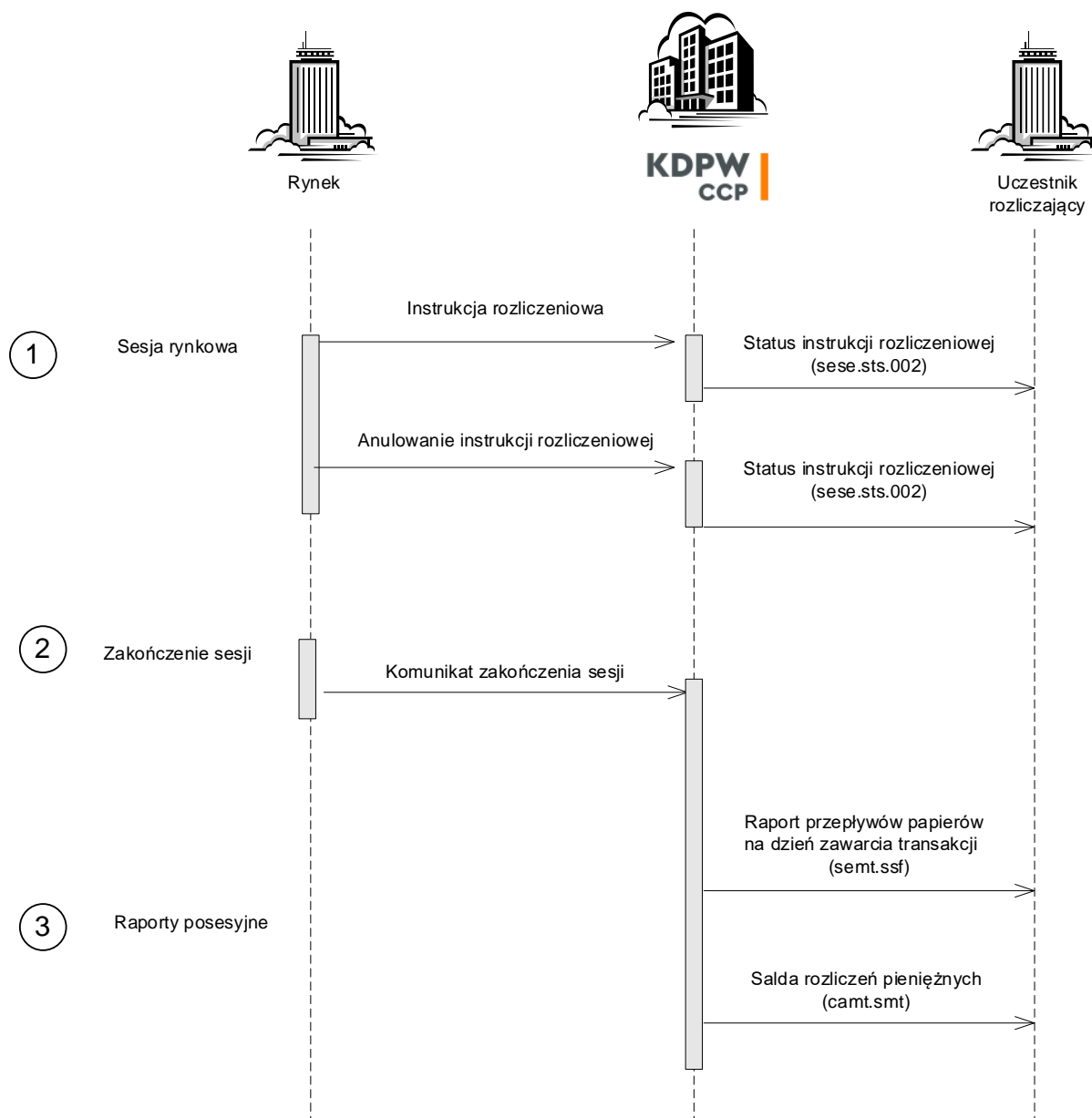
secl.009.001.03 – BuyInConfirmation – komunikat informujący o statusie realizacji procedury odkupu papierów wartościowych.

Uczestnik rozliczający może wnioskować do KDPW_CCP o odroczenie procedury odkupu papierów wartościowych za pomocą komunikatu secl.008.001.03.



4.3 Zachowanie wstecznej zgodności – pozostawienie dotychczasowych typów komunikatów

Uczestnicy KDPW_CCP, którzy nie będą zainteresowani otrzymywaniem komunikatów w nowych strukturach ISO20022, będą mogli otrzymywać analogiczne informacje w dotychczasowych formatach komunikatów xml systemu kdpw_stream:



Dla zachowania czytelności na powyższym schemacie zamieszczono jedynie komunikaty odpowiadające w dużym stopniu funkcjom nowych komunikatów ISO20022. Wszystkie pozostałe komunikaty systemu kdpw_stream zostaną również zachowane.

5. Szczegółowe zagadnienia związane z budową komunikatów

5.1 Stronicowanie raportów

Mając na uwadze efektywność przekazywania komunikatów w sieci telekomunikacyjnej, przewiduje się dzielenie dużych raportów na części, zwane stronami.

Spośród raportów opisywanych w niniejszej dokumentacji stronicowaniu mogą podlegać następujące komunikaty: secl.003.001.03, secl.004.001.03 i secl.010.001.03.

Numery kolejnych stron raportu będą przekazywane w polu *PgNb*, np.:

```
<PgNb>1</PgNb>
```

Ostatnia strona raportu wyróżniona będzie znacznikiem ostatniej strony ustawionym na wartość *true*:

```
<LastPgInd>true</LastPgInd>
```

Dla pozostałych stron znacznik ten będzie miał wartość *false*:

```
<LastPgInd>false</LastPgInd>
```

5.2 Nagłówek komunikatu: head.001.001.02 — Business Application Header i koperta techniczna

Głównym zadaniem standardowego nagłówka BAH – Business Application Header jest przekazanie identyfikatorów nadawcy i odbiorcy komunikatu na poziomie aplikacji biznesowej.

Nagłówek BAH pełni w komunikatach ISO20022 tę sama rolę, co atrybuty *Sndr* i *Rcvr* głównego elementu (*KDPWDocument*) komunikatów xml systemu kdpw_stream.

Specyfikacja oraz zasady wykorzystania nagłówka BAH są dostępne na stronach www.iso20022.org.

Zawartość komunikatu	Opis
<pre><?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <AppHdr xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.02"></pre>	
<pre><CharSet>utf_8</CharSet></pre>	Zestaw znaków
<pre><Fr> <OrgId> <Id> <OrgId> <AnyBIC>KDPWPLPW</AnyBIC> </OrgId> </Id> </OrgId> </Fr></pre>	Nadawca komunikatu (w podanym przykładzie w postaci kodu BIC). KDPW_CCP będzie stosować czteroznakowy kod '0010'
<pre><To> <OrgId> <Id> <OrgId> <Othr9> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </Othr9> </OrgId> </Id> </OrgId> </To></pre>	Odbiorca komunikatu (w podanym przykładzie w postaci czteroznakowego kodu nadawanego przez Grupę KDPW)
<pre><BizMsgIdr>id1</BizMsgIdr></pre>	Identyfikator komunikatu biznesowego
<pre><MsgDefIdr>secl.001.001.03</MsgDefIdr></pre>	Identyfikator typu komunikatu biznesowego
<pre><CreDt>2023-04-01T09:00:00Z</CreDt></pre>	Data i czas UTC (Coordinated Universal Time) utworzenia komunikatu
<pre></AppHdr></pre>	

System kdpw_stream wymaga połączenia nagłówka BAH i głównego dokumentu za pomocą koperty technicznej (RequestPayload). Struktura każdego komunikatu biznesowego jest zgodna z następującym szablonem:

```
<RequestPayload>  
  <AppHdr> ... </AppHdr>  
  <Document> ... </Document>  
</RequestPayload>
```

Schemat XML Schema dla powyższej struktury ma następującą postać:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>  
<xs:schema xmlns="kdpw:ISO20022BusinessMessage2"  
  xmlns:xs="http://www.w3.org/2001/XMLSchema"  
  targetNamespace="kdpw:ISO20022BusinessMessage2"  
  elementFormDefault="qualified">  
<xs:element name="RequestPayload" type="ISO20022BusinessMessage1"/>  
<xs:complexType name="ISO20022BusinessMessage1">  
  <xs:sequence>  
    <xs:any namespace="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.02"  
      processContents="strict"/>  
    <xs:any processContents="strict"/>  
  </xs:sequence>  
</xs:complexType>  
</xs:schema>
```

Poniżej przedstawiono przykładowy komunikat biznesowy wraz nagłówkiem BAH i kopertą techniczną Grupy KDPW:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<RequestPayload>
  <AppHdr xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
    xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.02">
    <CharSet>utf_8</CharSet>
    <Fr>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>0010</Id>
              <Issr>KDPW</Issr>
            </Othr>
          </OrgId>
        </Id>
      </OrgId>
    </Fr>
    <To>
      <OrgId>
        <Id>
          <OrgId>
            <Othr>
              <Id>09AA</Id>
              <Issr>KDPW</Issr>
            </Othr>
          </OrgId>
        </Id>
      </OrgId>
    </To>
    <BizMsgIdr>id1</BizMsgIdr>
    <MsgDefIdr>secl.001.001.01</MsgDefIdr>
    <CreDt>2023-04-01T10:00:00Z</CreDt>
  </AppHdr>
  <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance"
    xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.001.001.03">
    <TradLegNtfctn>
      <Id>
        <Id>id1</Id>
        <CreDtTm>
          <DtTm>2023-04-01T10:00:00</DtTm>
        </CreDtTm>
      </Id>
      <ClrMmb>
        .....(pozostała treść komunikatu)
      </TradLegNtfctn>
    </Document>
  </RequestPayload>
```

6. Opis zawartości komunikatów

6.1 Potwierdzenie przyjęcia transakcji: secl.001.001.03 — Trade Leg Notification

Komunikat przekazywany uczestnikom rozliczającym KDPW_CCP. Komunikat secl.001.001.03 przekazywany na bieżąco po każdej przyjętej transakcji do rozliczeń w KDPW_CCP. Komunikat ten prezentuje warunki zawartej transakcji na rynku.

Zawartość komunikatu	Opis
<pre><?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns=" urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.001.001.03"></pre>	
<TradLegNtfctn>	
<pre><ClrMmb> <PrtryId> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </ClrMmb></pre>	Czteroznakowy identyfikator uczestnika rozliczającego
<pre><ClrAcct> <Id>1111</Id> <Tp>HOUS</Tp> </ClrAcct></pre>	Identyfikator i typ konta rozliczeniowego w systemie KDPW_CCP Oznaczenia typów kont: CLIE – client (konto klienta) HOUS – house (konto papierów własnych) LIPR – liquidity provider (market maker) ELIP – zewnętrzny animator OTHR - pozostałe
<ClrDtIs>	
<pre><SttImNetgElgblCd>NETT</SttImNetgElgblCd></pre>	Kwalifikator przekazania do nettingu Dopuszczalne wartości: GROS – rozrachunek brutto NETT – rozrachunek netto
<pre><GrntedTrad>true</GrntedTrad></pre>	Znacznik gwarantowania transakcji Dopuszczalne wartości: true – transakcja gwarantowana false – transakcja niegwarantowana
<NonGrntedTrad>	Sekcja zawierająca identyfikator kontrpartniera Tylko dla transakcji <u>niegwarantowanych</u>
<pre><TradCtrPtyMmbId> <PrtryId> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </TradCtrPtyMmbId></pre>	Kontrpartner zawierający transakcję. Tylko dla transakcji <u>niegwarantowanych</u>
<pre><TradCtrPtyClrMmbId> <PrtryId> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </TradCtrPtyClrMmbId></pre>	Uczestnik rozliczający kontrpartniera zawierającego transakcję. Tylko dla transakcji <u>niegwarantowanych</u>
</NonGrntedTrad>	
</ClrDtIs>	
<TradLegDtIs>	
<pre><TradLegId>UTP_TR1</TradLegId></pre>	Identyfikator transakcji nadany przez rynek
<pre><TradId>Z1</TradId></pre>	Identyfikator zlecenia nadany przez brokera

<code><TradExctnId>UTP_Z1</TradExctnId></code>	Identyfikator zlecenia nadany przez rynek
<code><TradDt>2023-04-01T09:59:10</TradDt></code>	Data i czas zawarcia transakcji
<code><SttlmDt> <Dt>2023-04-04</Dt> </SttlmDt></code>	Planowana data rozrachunku
<code><FinInstrmId> <ISIN>PL1234567890</ISIN> <OthrId> <Id>ASDFGHJAJ</Id> <Tp> <Cd>PSCD</Cd> </Tp> </OthrId> </FinInstrmId></code>	Kod ISIN instrumentu finansowego Dodatkowo w polu <i>OthrId</i> mogą pojawić się identyfikatory stosowane przez system giełdowy: PSCD - pseudokod ISIN dla transakcji spoza notowań na podstawowym segmencie rynku systemu UTP
<code><BuySellInd>BUYI</BuySellInd></code>	Wskaźnik kupna /sprzedaży Dopuszczalne wartości: BUYI – kupno SELL – sprzedaż
<code><TradQty> <Unit>100</Unit> lub <FaceAmt>100000</FaceAmt> </TradQty></code>	Liczba instrumentów finansowych
<code><DealPric> <Val> <Amt Ccy="PLN">1000</Amt> </Val> </DealPric></code>	Kurs zawarcia transakcji
<code><PlcOfTrad> <Id> <MktIdrCd>XWAR</MktIdrCd> </Id> <Tp> <Cd>EXCH</Cd> </Tp> </PlcOfTrad></code>	Miejsce zawarcia transakcji w postaci kodu MIC oraz typu rynku. Stosowane wartości typu rynku: EXCH – transakcja giełdowa PRIM – rynek pierwotny
<code><TradTp>OOBK</TradTp></code>	Typ transakcji Wartości stosowane w kdpw_stream: OOBK – transakcja rynkowa
<code><TradgPty> <PrtryId> <Id>09BB</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </TradgPty></code>	Identyfikator uczestnika zawierającego transakcję na rynku
<code><TradgCpcty>PRIN</TradgCpcty></code>	Rodzaj transakcji: AGEN – transakcja na konto klienta PRIN – transakcja na konto papierów własnych
<code></TradLegDtls></code>	
<code><SttlmDtls></code>	
<code><SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">100000</Amt> </SttlmAmt></code>	Wartość rozrachunku
<code></SttlmDtls></code>	
<code></TradLegNtfctn></code>	
<code></Document></code>	

6.2 Potwierdzenie usunięcia transakcji: secl.002.001.03 — Trade Leg Cancellation

Komunikat przekazywany uczestnikom rozliczającym KDPW_CCP w przypadku anulowania wcześniej przyjętej transakcji do rozliczeń.

Zawartość komunikatu	Opis
<pre><?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.002.001.03"></pre>	
<pre><TradLegNtfctnCxl></pre>	
<pre><ClrMmb> <PrtryId> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </ClrMmb></pre>	Czteroznakowy identyfikator uczestnika rozliczającego
<pre><ClrAcct> <Id>1111</Id> <Tp>HOUS</Tp> </ClrAcct></pre>	<p>Identyfikator i typ konta rozliczeniowego w systemie KDPW_CCP</p> <p>Oznaczenia typów kont:</p> <p>CLIE – client (konto klienta)</p> <p>HOUS – house (konto papierów własnych)</p> <p>LIPR – liquidity provider (market maker)</p> <p>ELIP – zewnętrzny animator</p> <p>OTHR - pozostałe</p>
<pre><ClrDtls></pre>	
<pre><SttlmNetgElgblCd>NETT</SttlmNetgElgblCd></pre>	<p>Kwalifikator przekazania do nettingu</p> <p>Dopuszczalne wartości:</p> <p>GROS – rozrachunek brutto</p> <p>NETT – rozrachunek netto</p>
<pre></ClrDtls></pre>	
<pre><TradLegDtls></pre>	
<pre><TradLegId>UTP_TR1</TradLegId></pre>	Identyfikator transakcji nadany przez rynek
<pre><TradId>Z1</TradId></pre>	Identyfikator zlecenia nadany przez brokera
<pre><TradExctnId>UTP_Z1</TradExctnId></pre>	Identyfikator zlecenia nadany przez rynek
<pre><TradDt>2023-04-01T09:10:10</TradDt></pre>	Data i czas zawarcia transakcji
<pre><SttlmDt> <Dt>2023-04-03</Dt> </SttlmDt></pre>	Przewidywana data rozrachunku
<pre><FinInstrmId> <ISIN>PL1234567890</ISIN> <OthrId> <Id>ASDFGHJAJ</Id> <Tp> <Cd>PSCD</Cd> </Tp> </OthrId> </FinInstrmId></pre>	<p>Kod ISIN instrument finansowego</p> <p>Dodatkowo w polu <i>OthrId</i> mogą pojawić się identyfikatory stosowane przez system giełdowy:</p> <p>PSCD - pseudokod ISIN dla transakcji spoza notowań na podstawowym segmencie rynku systemu UTP.</p>
<pre><BuySellInd>BUYI</BuySellInd></pre>	<p>Wskaźnik kupna /sprzedaży</p> <p>Dopuszczalne wartości:</p> <p>BUYI – kupno</p> <p>SELL – sprzedaż</p>
<pre><TradQty> <Unit>100</Unit> lub <FaceAmt>100000</FaceAmt> </TradQty></pre>	Liczba instrumentów finansowych

<pre> <DealPric> <Val> <Amt Ccy="PLN">1000</Amt> </Val> </DealPric> </pre>	Kurs zawarcia transakcji
<pre> <PlcOfTrad> <Id> <MktldrCd>XWAR</MktldrCd> </Id> <Tp> <Cd>EXCH</Cd> </Tp> </PlcOfTrad> </pre>	<p>Miejsce zawarcia transakcji w postaci kodu MIC oraz typu rynku.</p> <p>Stosowane wartości typu rynku: EXCH – transakcja giełdowa PRIM – rynek pierwotny</p>
<pre> <TradTp>OOBK</TradTp> </pre>	<p>Typ transakcji</p> <p>Wartości stosowane w kdpw_stream: OOBK – transakcja rynkowa</p>
<pre> <TradgPty> <PrtryId> <Id>09BB</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </TradgPty> </pre>	Identyfikator uczestnika zawierającego transakcję na rynku
<pre> <TradgCpcty>PRIN</TradgCpcty> </pre>	<p>Rodzaj transakcji:</p> <p>AGEN – transakcja na konto klienta PRIN – transakcja na konto papierów własnych</p>
<pre> </TradLegDtls> </pre>	
<pre> <SttlmDtls> </pre>	
<pre> <SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">100000</Amt> </SttlmAmt> </pre>	Wartość rozrachunku
<pre> </SttlmDtls> </pre>	
<pre> </TradLegNtfctnCxl> </Document> </pre>	

6.3 Zestawienie zawartych transakcji: secl.003.001.03 — Trade Leg Statement

Komunikat przekazywany uczestnikom rozliczającym KDPW_CCP, zawierający zestawienie transakcji uczestnika rozliczającego przyjętych do rozliczeń w danym dniu.

Komunikat przekazywany na koniec dnia rozliczeniowego.

Zawartość komunikatu	Opis
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.003.001.03">	
<TradLegStmnt>	
<StmntParams>	
<StmntId>Stmnt1</StmntId>	Identyfikator zestawienia wspólny dla wszystkich stron raportu
<StmntDtAndTm> <DtTm>2023-04-01T17:00:00</DtTm> </StmntDtAndTm>	Data i czas, której dotyczy zestawienie
<UpdTp>COMP</UpdTp>	Wskaźnik rodzaju danych zawartych w zestawieniu: COMP – pełne dane DELT – tylko zmiany (niewykorzystywany przez kdpw_stream)
<Frqcy>DAIL</Frqcy>	Rodzaj raportu: DAIL – raport dzienny INDA – raport w trakcie dnia (niewykorzystywany w kdpw_stream) ONDE – raport na żądanie (niewykorzystywany w kdpw_stream)
<ActvtyInd>true</ActvtyInd>	Wskaźnik aktywności w raportowanym okresie
</StmntParams>	
<Pgntn> <PgNb>1</PgNb> <LastPgInd>true</LastPgInd> </Pgntn>	Numer strony Wartości pola <i>LastPgInd</i> : true – dla ostatniej strony false – dla pozostałych stron
<ClrMmb> <PrtryId> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </ClrMmb>	Identyfikator KDPW uczestnika rozliczającego
<StmntDtIs>	
<ClrAcct> <Id>1111</Id> <Tp>HOUS</Tp> </ClrAcct>	Identyfikator i typ konta rozliczeniowego w systemie KDPW_CCP Oznaczenia typów kont: CLIE – client (konto klienta) HOUS – house (konto papierów własnych) LIPR – liquidity provider (market maker) ELIP – zewnętrzny animator OTHR - pozostałe
<TradLegsDtIs>	
<TradLegId>Z1</TradLegId>	Identyfikator transakcji nadany przez rynek
<TradId>Z1</TradId>	Identyfikator zlecenia nadany przez brokera
<TradExctnId>UTP_TR1</TradExctnId>	Identyfikator zlecenia nadany przez rynek

<TradDt>2023-04-01T09:10:10</TradDt>	Data i czas zawarcia transakcji
<SttImDt> <Dt>2023-04-04</Dt> </SttImDt>	Przewidywana data rozrachunku
<FinInstrmId> <ISIN>PL1234567890</ISIN> </FinInstrmId>	Kod ISIN instrumentu finansowego
<BuySellInd>BUYI</BuySellInd>	Wskaźnik kupna /sprzedaży Dopuszczalne wartości: BUYI – kupno SELL – sprzedaż
lub <TradQty> <Unit>100</Unit> <FaceAmt>100000</FaceAmt> </TradQty>	Liczba instrumentów finansowych
<DealPric> <Val> <Amt Ccy="PLN">1000</Amt> </Val> </DealPric>	Kurs transakcji
<PlcOfTrad> <Id> <MktIdrCd>XWAR</MktIdrCd> </Id> <Tp> <Cd>EXCH</Cd> </Tp> </PlcOfTrad>	Miejsce zawarcia transakcji w postaci kodu MIC oraz typu rynku. Stosowane wartości typu rynku: EXCH – transakcja giełdowa PRIM – rynek pierwotny
<TradTp>OOBK</TradTp>	Typ transakcji Wartości stosowane w kdpw_stream: OOBK – transakcja rynkowa
<TradgPty> <PrtryId> <Id>09BB</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </TradgPty>	Identyfikator uczestnika zawierającego transakcję na rynku
<TradgCpcty>AGEN</TradgCpcty>	Rodzaj transakcji: AGEN – transakcja na konto klienta PRIN – transakcja na konto papierów własnych
<ClrDtIs>	
<SttImNetgElgblCd>NETT</SttImNetgElgblCd>	Kwalifikator przekazania do nettingu Dopuszczalne wartości: GROS – rozrachunek brutto NETT – rozrachunek netto
</ClrDtIs>	
</TradLegsDtIs>	
<TradLegsDtIs>	
.....	<i>Szczegóły kolejnych transakcji</i>
</TradLegsDtIs>	
</StmtDtIs>	
</TradLegStmt>	
</Document>	

6.4 Zestawienie pozycji rozliczeniowych netto: secl.004.001.03 — Net Positions Report

Komunikat przekazywany uczestnikom rozliczającym KDPW_CCP, zawierający zestawienie zagregowanych pozycji rozliczeniowych netto wynikających z transakcji przyjętych do rozliczeń w danym dniu.

Komunikat przekazywany na koniec dnia rozliczeniowego.

Zawartość komunikatu	Opis
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.004.001.03">	
<NetPos>	
<RptParams>	
<NetPosId>Net Pos1</NetPosId>	Identyfikator pozycji rozliczeniowej
<RptDtAndTm> <DtTm>2023-04-01T17:00:00</DtTm> </RptDtAndTm>	Data i czas wyznaczenia pozycji rozliczeniowej
<UpdTp>COMP</UpdTp>	Wskaźnik rodzaju danych zawartych w zestawieniu: COMP – pełne dane DELT – tylko zmiany (niewykorzystywany przez kdpw_stream)
<Frqcy>DAIL</Frqcy>	Rodzaj raportu: DAIL – raport dzienny INDA – raport w trakcie dnia (niewykorzystywany) ONDE – raport na żądanie (niewykorzystywany)
<ActvtyInd>true</ActvtyInd>	Wskaźnik aktywności w raportowanym okresie
</RptParams>	
<Pgntn> <PgNb>1</PgNb> <LastPgInd>true</LastPgInd> </Pgntn>	Numer strony Wartości pola <i>LastPgInd</i> : true – dla ostatniej strony false – dla pozostałych stron
<ClrMmb> <PrtryId> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </ClrMmb>	Identyfikator KDPW uczestnika rozliczającego
<NetPosRpt>	
<ClrAcct> <Id>1CLR_ACC_HOUSE</Id> <Tp>HOUS</Tp> </ClrAcct>	Identyfikator i typ konta rozliczeniowego w systemie KDPW Oznaczenia typów kont: CLIE – client (konto klienta) HOUS – house (konto papierów własnych) LIPR – liquidity provider (market maker) ELIP – zewnętrzny animator OTHR - pozostałe
<DivryAcct> <Id>2222</Id> <Nm>Konto do rozrachunku</Nm> </DivryAcct>	Identyfikator konta i nazwa konta agenta ds. rozrachunku w KDPW

<FinInstrmId> <ISIN>PL1234567890</ISIN> </FinInstrmId>	Kod ISIN instrument finansowego
<NetPosAmt> <Amt Ccy="PLN">4100</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </NetPosAmt>	Wartość pozycji rozliczeniowej
<NetQty> <Unit>410</Unit> </NetQty>	Liczba instrumentów finansowych w pozycji rozliczeniowej
<SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp>	Kierunek przepływu instrumentów finansowych DELI – dostawa RECE - przyjęcie
<Dpstry> <BIC>KDPWPLPW</BIC> </Dpstry>	Kod BIC Depozytu papierów wartościowych
<TradLegDtIs>	Opcjonalna sekcja wskazująca szczegóły transakcji
<TradLegId>Z1</TradLegId>	Identyfikator transakcji nadany przez rynek
<TradId>Z1</TradId>	Identyfikator zlecenia nadany przez brokera
<TradExctnId>UTP_TR1</TradExctnId>	Identyfikator zlecenia nadany przez rynek
<TradDt>2023-04-01</TradDt>	Data zawarcia transakcji
<SttlmDt> <Dt>2023-04-04</Dt> </SttlmDt>	Przewidywana data rozrachunku
<BuySellInd>BUYI</BuySellInd>	Wskaźnik kupna /sprzedaży Dopuszczalne wartości: BUYI – kupno SELL – sprzedaż
<TradQty> <Unit>100</Unit> lub <FaceAmt>100000</FaceAmt> </TradQty>	Liczba instrumentów finansowych
<DealPric> <Val> <Amt Ccy="PLN">1000</Amt> </Val> </DealPric>	Kurs transakcji
<PlcOfTrad> <Id> <MktIdrCd>XWAR</MktIdrCd> </Id> <Tp> <Cd>EXCH</Cd> </Tp> </PlcOfTrad>	Miejsce zawarcia transakcji w postaci kodu MIC oraz typu rynku. Stosowane wartości typu rynku: EXCH – transakcja giełdowa PRIM – rynek pierwotny
<TradTp>OOBK</TradTp>	Typ transakcji Wartości stosowane w kdpw_stream: OOBK – transakcja rynkowa
<TradgPty> <PrtryId> <Id>09BB</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </TradgPty>	Identyfikator uczestnika zawierającego transakcję na rynku

<TradgCpcty>AGEN</TradgCpcty>	Rodzaj transakcji: AGEN – transakcja na konto klienta PRIN – transakcja na konto papierów własnych
</TradLegDtls>	
<TradLegsDtls>	
.....	<i>Szczegóły kolejnych transakcji</i>
</TradLegsDtls>	
</NetPosRpt>	
<NetPosRpt>	
.....	<i>Szczegóły kolejnych pozycji rozliczeniowych</i>
<TradLegDtls>	<i>Szczegóły kolejnych transakcji</i>
.....	
</TradLegDtls>	
</NetPosRpt>	
</NetPos>	
</Document>	

6.5 Zestawienie zobowiązań rozrachunkowych: secl.010.001.03 — Settlement Obligations Report

Komunikat przekazywany uczestnikom rozliczającym KDPW_CCP, zawierający zestawienie zobowiązań i należności rozrachunkowych uczestnika rozliczającego.

Komunikat przekazywany na koniec dnia rozliczeniowego.

Zawartość komunikatu	Opis
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.010.001.03" >	
<SttlmOblgtnRpt>	
<RptParams>	
<RptId>Sett obl rep 1</RptId>	Identyfikator raportu (wspólny dla wszystkich stron)
<RptDtAndTm> <DtTm>2023-04-01T17:00:00</DtTm> </RptDtAndTm>	Data i czas, której dotyczy zestawienie
</RptParams>	
<Pgntn> <PgNb>1</PgNb> <LastPgInd>true</LastPgInd> </Pgntn>	Numer strony Wartości pola <i>LastPgInd</i> : true – dla ostatniej strony false – dla pozostałych stron
<ClrMmb> <PrtryId> <Id>09AA</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </ClrMmb>	Czteroznakowy identyfikator uczestnika rozliczającego
<DlvryAcct> <Id>2222</Id> <Nm>Konto do rozrachunku</Nm> </DlvryAcct>	Identyfikator konta i nazwa konta agenta ds. rozrachunku w KDPW
<RptDtIs>	
<SttlmOblgtnDtIs>	
<SttlmOblgtnId>Set obl 1</SttlmOblgtnId>	Identyfikator naliczonych zobowiązań/ należności
<FinInstrmId> <ISIN>PL1234567890</ISIN> </FinInstrmId>	Kod ISIN instrumentu finansowego
<IntnddSttlmDt> <Dt> <Dt>2023-04-04</Dt> </Dt> </IntnddSttlmDt>	Przewidywana data rozrachunku
<Qty> <Unit>410</Unit> lub <FaceAmt>410000</FaceAmt> </Qty>	Liczba instrumentów finansowych dla wskazanego zobowiązania lub należności uczestnika
<SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">4100</Amt> </SttlmAmt>	Wartość zobowiązań lub należności w środkach pieniężnych

<pre> <PlcOfTrad> <Id> <MktIdrCd>XWAR</MktIdrCd> </Id> <Tp> <Cd>EXCH</Cd> </Tp> </PlcOfTrad> </pre>	<p>Miejsce zawarcia transakcji w postaci kodu MIC oraz typu rynku.</p> <p>Stosowane wartości typu rynku: EXCH – transakcja giełdowa PRIM – rynek pierwotny</p>
<pre> <SctiesMvmntTp>DELI</SctiesMvmntTp> </pre>	<p>Kierunek przepływu instrumentów finansowych DELI – dostawa RECE - przyjęcie</p>
<pre> <Pmt>APMT</Pmt> </pre>	<p>Określenie płatności: APMT – z płatnością FREE – bez płatności</p>
<pre> </SttlmOblgtnDtls> </pre>	
<pre> <SttlmOblgtnDtls> </pre>	
<pre> </pre>	<p><i>Dane kolejnych pozycji rozrachunkowych</i></p>
<pre> </SttlmOblgtnDtls> </pre>	
<pre> </RptDtls> </pre>	
<pre> </SttlmOblgtnRpt> </pre>	
<pre> </Document> </pre>	

6.6 Powiadomienie o procedurze odkupu papierów wartościowych: secl.007.001.03 — BuyInNotification

Komunikat przekazywany uczestnikom rozliczającym KDPW_CCP, informujący o rozpoczęciu procedury odkupu papierów wartościowych

Zawartość komunikatu	Opis
<pre><?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns=" urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.007.001.03"> <BuyInNtfctn></pre>	
<pre><TxId>00015</TxId></pre>	Identyfikator procedury odkupu
<pre><ClrMmb> <PrtryId> <Id>5001</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </ClrMmb></pre>	Kod uczestnika rozliczającego powodującego zawieszenie rozrachunku lub kod KDPW_CCP w przypadku, gdy powiadomienie wysłane jest do uczestnika oczekującego na dostarczenie papierów wartościowych
<pre><NtfctnDtIs></pre>	Szczegóły powiadomienia
<pre><XpctdBuyInDt> <Dt>2020-10-14</Dt> </XpctdBuyInDt></pre>	Oczekiwana data realizacji odkupu papierów wartościowych
<pre></NtfctnDtIs></pre>	
<pre><OrgnlSttlmOblgtn></pre>	Zawiera szczegółowe informacje na temat pierwotnej pozycji rozliczeniowej, dla której zostanie uruchomiona procedura odkupu
<pre><IntnddSttlmDt>2020-10-09</IntnddSttlmDt></pre>	Planowana data rozrachunku pozycji podlegającej procedurze odkupu
<pre><FinInstrmId> <ISIN>PLTLKPL00017</ISIN> </FinInstrmId></pre>	Kod ISIN
<pre><TradDt>2020-10-07</TradDt></pre>	Data zawarcia pierwotnych transakcji wchodzących w skład pozycji podlegającej procedurze odkupu
<pre><DealPric> <Val> <Amt Ccy="PLN">2.00</Amt> </Val> </DealPric></pre>	Cena jednostkowa instrumentów wchodzących w skład pozycji podlegającej procedurze odkupu
<pre><Qty> <Unit>400</Unit> Lub <FaceAmt>400000</FaceAmt> </Qty></pre>	Liczba instrumentów udziałowych lub wartość nominalna instrumentów dłużnych dla pierwotnej pozycji
<pre><Dpstry> <BIC>KDPWLPW</BIC> </Dpstry></pre>	KDPWLPW - BIC
<pre><RmngQtyToBeSttlId> <Unit>200</Unit> Lub <FaceAmt>200000</FaceAmt> </RmngQtyToBeSttlId></pre>	Pozostająca liczba/wartość nominalna papierów wartościowych do rozliczenia
<pre><SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">800</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </SttlmAmt></pre>	Wartość i waluta rozliczenia

<code><RmngAmtToBeSttld></code> <code><Amt Ccy="PLN">400</Amt></code> <code><CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd></code> <code></RmngAmtToBeSttld></code>	Pozostająca wartość transakcji podlegającej procedurze odkupu
<code></OrgnlSttlmOblgtn></code>	
<code></BuyInNtfctn></code>	
<code></Document></code>	

6.7 Powiadomienie o realizacji procedury odkupu papierów wartościowych: secl.009.001.03 — BuyInConfirmation

Komunikat wysyłany do uczestników rozliczających KDPW_CCP, potwierdzający status realizacji procedury odkupu papierów wartościowych.

Zawartość komunikatu	Opis
<pre><?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.009.001.03"> <BuyInConf></pre>	
<pre><TxId>TRAD123</TxId></pre>	Identyfikator procedury odkupu
<pre><ClrMmb> <PrtryId> <Id>5001</Id> <Issr>KDPW</Issr> </PrtryId> </ClrMmb></pre>	Kod uczestnika rozliczającego powodującego zawieszenie rozrachunku lub kod KDPW_CCP w przypadku, gdy powiadomienie wysyłane jest do uczestnika oczekującego na dostarczenie papierów wartościowych
<pre><BuyInDtIs></pre>	Szczegóły powiadomienia o transakcji odkupu
<pre><BuyInId>12345</BuyInId></pre>	Identyfikator transakcji odkupu zrealizowanego przez KDPW_CCP lub identyfikator procedury odkupu w przypadku wypłaty rekompensaty
<pre><Dt>2020-10-14</Dt></pre>	Data transakcji odkupu lub data bieżąca w przypadku wypłaty rekompensaty
<pre><Pric> <Val> <Amt Ccy="PLN">2.10</Amt> </Val> </Pric></pre>	Cena jednostkowa transakcji odkupu lub cena rynkowa służąca wyliczeniu rekompensaty
<pre><SctiesBuyIn></pre>	
<pre><Dpstry> <BIC>KDPWPLPW</BIC> </Dpstry></pre>	KDPWLPW - BIC
<pre><SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">420</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </SttlmAmt></pre>	Wartość i waluta rozrachunku
<pre><Fees> <Amt Ccy="PLN">20</Amt> <CdtDbtInd>CRDT</CdtDbtInd> </Fees></pre>	Zwrot różnicy w cenie dla KDPW_CCP
<pre></SctiesBuyIn></pre>	Szczegółowe informacje na temat wymaganej rekompensaty pieniężnej, w przypadku gdy KDPW_CCP nie mógł kupić całości papierów wartościowych.
<pre><ReqrdCshCompstn></pre>	Sekcja wypełniana w przypadku, gdy brak jest możliwości odkupu lub odkup jest nie skuteczny
<pre><SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">100</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </SttlmAmt></pre>	Wartość i waluta rekompensaty
<pre><ValDt>2020-10-15</ValDt></pre>	Data wypłaty rekompensaty
<pre></ReqrdCshCompstn></pre>	
<pre></BuyInDtIs></pre>	
<pre><OrgnSttlmOblgtn></pre>	

<IntnddSttlmDt>2020-10-09</IntnddSttlmDt>	Planowana data rozrachunku transakcji podlegającej procedurze odkupu
<FinInstrmId> <ISIN>PLTLKPL00017</ISIN> </FinInstrmId>	Kod ISIN papieru wartościowego, będącego przedmiotem odkupu
<TradDt>2020-10-07</TradDt>	Data zawarcia transakcji podlegającej procedurze odkupu
<DealPric> <Val> <Amt Ccy="PLN">2.00</Amt> </Val> </DealPric>	Cena zawarcia transakcji podlegającej procedurze odkupu
<Qty> <Unit>400</Unit> Lub <FaceAmt>400000</FaceAmt> </Qty>	Liczba papierów lub wartość nominalna
<Dpstry> <BIC>KDPWLPW</BIC> </Dpstry>	KDPWLPW - BIC
<RmngQtyToBeSttld> <Unit>200</Unit> Lub <FaceAmt>200000</FaceAmt> </RmngQtyToBeSttld>	Pozostająca liczba/wartość nominalna papierów wartościowych do rozliczenia
<SttlmAmt> <Amt Ccy="PLN">800</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </SttlmAmt>	Wartość i waluta rozliczenia
<RmngAmtToBeSttld> <Amt Ccy="PLN">400</Amt> <CdtDbtInd>DBIT</CdtDbtInd> </RmngAmtToBeSttld>	Pozostająca wartość transakcji podlegającej procedurze odkupu
</OrgnlSttlmOblgtn>	
</BuyInConf>	
</Document>	

6.8 Odroczenie procedury odkupu papierów wartościowych: secl.008.001.03 — BuyInResponse

Komunikat wysyłany przez uczestnika rozliczającego do KDPW_CCP o odroczenie procedury odkupu papierów wartościowych przekazanej w secl.007.001.03.

Zawartość komunikatu	Opis
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?> <Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:secl.008.001.03">	
<BuyInRspn>	
<TxId>TRAD123</TxId>	Identyfikator procedury odkupu
<BuyInRspnDtls>	
<BuyInNtfctnId>ABC</BuyInNtfctnId>	
<ReqForDelyInd>true</ReqForDelyInd>	Znacznik żądania odroczenia procedury odkupu
<NbOfDays>4</NbOfDays>	Liczba dni odroczenia
<InitlQty> <Unit>100</Unit> lub <FaceAmt>100000</FaceAmt> </InitlQty>	Liczba lub wartość nominalna papierów do odkupu
<CvrdQty> <Unit>0</Unit> lub <FaceAmt>0</FaceAmt> </CvrdQty>	Liczba lub wartość nominalna papierów wartościowych odkupiona
<UcvrdQty> <Unit>100</Unit> lub <FaceAmt>100000</FaceAmt> </UcvrdQty>	Liczba lub wartość nominalna papierów wartościowych pozostała do odkupu
</BuyInRspnDtls>	
</BuyInRspn>	
</Document>	