

*Materiał informacyjny dotyczący przepływu komunikatów w KDPW\_TR dla transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych.*

Data	Wersja	Autor	Opis
18.04.2019	1.0	KDPW_TR	Powstanie dokumentu
12.12.2019	1.1	KDPW_TR	Dodanie rozdziału 2.3 Komunikat statusowy, rozbudowanie słownika pojęć, aktualizacja nazw komunikatów ISO 20022, aktualizacja rozdziału 3.
10.04.2024	1.2	KDPW_TR	Aktualizacja w związku z zmianą komunikatu aut.rlt.001.01 na auth.rlt.001.02

## Spis treści

1.	Słownik pojęć.....	2
2.	Komunikaty.....	3
2.1.	Rodzaje komunikatów .....	3
2.2.	Komunikat statusowy – budowanie referencji do komunikatów wejściowych.....	3
3.	Przepływy komunikatów podczas raportowania szczegółów transakcji oraz zdarzeń związanych z transakcjami SFT. ....	5
3.1.	Raportowanie transakcji i zdarzeń .....	5
3.2.	Przekazywanie wyników rekoncyliacji.....	6
3.3.	Komunikat notyfikacyjny (zgłoszenie przez RC błędu w raporcie) .....	7
3.4.	Definiowanie relacji w bazach Repozytorium .....	8
3.5.	Raporty końca dnia.....	9

## 1. Słownik pojęć

**KDPW\_TR** - usługa repozytorium transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych (zwanymi dalej SFT) oferowana przez KDPW S.A.,

**Podmiot raportujący** - Podmiot przekazujący raporty w ramach wymogów określonych przez Rozporządzenie SFTR (z ang. Securities Financing Transaction Regulation; nr 2015/2365 z dn. 25 listopada 2015 r.),

**Rozporządzenie SFTR** (ang. securities financing transactions and o reuse)- Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenie (UE) nr 648/2012,

**Repozytorium** – organizowane i prowadzone przez KDPW S.A. Repozytorium Transakcji dla transakcji finansowych z użyciem papierów wartościowych prowadzone zgodnie z rozporządzeniem SFTR,

**RC** – strona transakcji SFT (Reporting Counterparty), podmiot zawierający transakcje SFTR zobowiązany do raportowania,

**RSE** - podmiot składający raport (Report Submitting Entity),

**ERR**- podmiot odpowiedzialny za raportowanie (Entity Responsible for Reporting),

**LEI** – (Legal Entity Identifier) unikalny identyfikator podmiotu zgodny z normą ISO 17442,

**Uczestnik** – podmiot nawiązujący z KDPW S.A. umowę uczestnictwa w Repozytorium,

**Transakcja SFT** – transakcja finansowa z użyciem papierów wartościowych (SFT), o której mowa w art. 3 pkt 11 Rozporządzenia SFTR, podlegająca obowiązkowi zgłoszenia do repozytorium transakcji,

**Raport** – zgłoszenie do Repozytorium szczegółowych informacji dotyczących zawarcia, zmiany lub zakończenia transakcji SFT, a także zgłoszenia lub zmiany depozytu zabezpieczającego i ponownego wykorzystania (ReUse),

**Regulamin** - Regulamin SFTR KDPW\_TR – REGULAMIN REPOZYTORIUM TRANSAKCJI DLA TRANSAKCJI FINANSOWYCH Z UŻYCIEM PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH. Przyjęty uchwałą Rady Nadzorczej KDPW nr 49/817/19 z dnia 11 października 2019 r. obowiązujący od 12 grudnia 2019r. wraz z późniejszymi zmianami

## 2. Komunikaty

### 2.1. Rodzaje komunikatów

Komunikaty dziedzinowe wykorzystywane w procesie raportowania transakcji SFT w relacji z Podmiotami raportującymi:

- auth.052.001.02 - komunikat służący do składania raportów o detalach transakcji SFT
- auth.070.001.02 - komunikat służący do składania raportów o depozytach zabezpieczających
- auth.071.001.02 - komunikat służący do składania raportów o ponownym wykorzystaniu zabezpieczenia
- auth.031.001.01 – komunikat statusowy do komunikatów auth.052.001.02; auth.070.001.02; auth.071.001.02
- auth.080.001.02 - komunikat statusowy z informacją zwrotną dotyczącą procesu rekoncyliacji
- auth.rlt.001.02 - komunikat własny KDPW, służący do realizowania obowiązku definiowania relacji między RSE a RC w bazach systemu KDPW\_TR, o którym mowa w § 12a Regulaminu;
- auth.ntf.001.01 – komunikaty własne KDPW służące do komunikacji z Podmiotem raportującym

### 2.2. Komunikat statusowy – budowanie referencji do komunikatów wejściowych

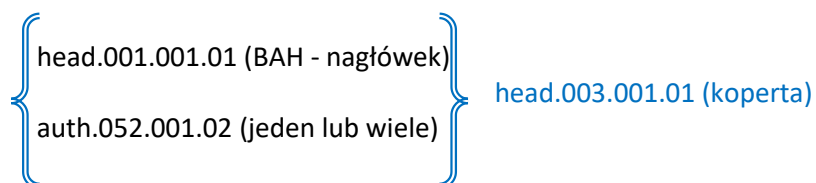
Zgodnie z zasadami przekazywania komunikatów zgodnych z ISO 20022 wszystkie komunikaty kierowane do systemu repozytorium SFTR muszą być opatrzone nagłówkiem i kopertą.

Na plik składają się opakowane w kopertę (komunikat head.003):

- a. Nagłówek: Business Application Header – head.001.001.01,
- b. Komunikat dziedzinowy.

Na potrzeby robocze plik będzie nazywany zgodnie z nazwą komunikatu dziedzinowego.

Przykładowy plik:



W usłudze SFTR pliki (komunikaty) należy kierować do odbiorcy R001 – kod komunikacyjny SFTR KDPW\_TR.

W odpowiedzi na komunikat wejściowy KDPW\_TR zwrotnie przekazywał będzie komunikat statusowy auth.031.001.01. Relacja do pliku wejściowego będzie budowana w następujący sposób:

1. W przypadku niezgodności ze schemą (XSD schema) pliku wejściowego lub błędnej nazwy pliku, w komunikacie statusowym w:

1.1. nagłówku (head.001.001.01) w sekcji **Related**, w tag-u **BizMsgIdr** znajdzie się identyfikator zbudowany zgodnie z poniższym algorytmem:

```
<BizMsgIdr> 444564c20202020202020798e575e1bf22223</BizMsgIdr>
```

gdzie:

- 444564c20202020202020798e575e1bf22223 – oznacza ostatnie 35 znaków z numeru MQ ID nadanego przez Menedżer MQ. MQ ID jest udostępniane nadawcy komunikatu wejściowego i składa się z 48 znaków: 414d512045585444564c202020202020798e575e1bf22223.

Dodatkowo w tej samej sekcji w tagu **CreDt** znajdzie się również stempel czasowy – data przyjęcia komunikatu od uczestnika,

- komunikacie auth.031.001.01 w sekcji **StsAdvc** -> **MsgSts** -> **RptSts** (status wiadomości) zwrócony zostanie status 'CRPT' – Corrupted File.

2. W przypadku błędu autoryzacji w odwołaniu do identyfikatora umieszczonego w BAH komunikatu wejściowego w:

- nagłówku (head.001.001.01) w sekcji **Related**, w tag-u **MsgDfIdr** znajdzie się identyfikator przekazany w pliku wejściowym w **To**, w tag-u **BizMsgIdr**
- komunikacie auth.031.001.01 w sekcji **StsAdvc** -> **MsgSts** -> **RptSts** (status wiadomości) zwrócony zostanie status 'RJCT' – Rejected oraz podana zostanie przyczyna odrzucenia.

3. W przypadku przekazania prawidłowego formalnie pliku, komunikat statusowy budowany jest w następujący sposób:

3.1. w nagłówku (head.001.001.01) w sekcji **To**, w tag-u **BizMsgIdr** znajdzie się identyfikator przekazany w pliku wejściowym w **From**, w tag-u **BizMsgIdr**

3.2. w komunikacie auth.031.001.01 w sekcji **StsAdvc** -> **MsgSts** -> **RptSts** (status wiadomości) zwrócony zostanie status 'ACPT' (Accepted) lub 'RJCT' (Rejected) oraz podana zostanie statystyka rekordów zaakceptowanych lub odrzuconych

3.3. w komunikacie auth.031.001.01 w sekcji **RcrdSts** – status rekordu, w tag-u:

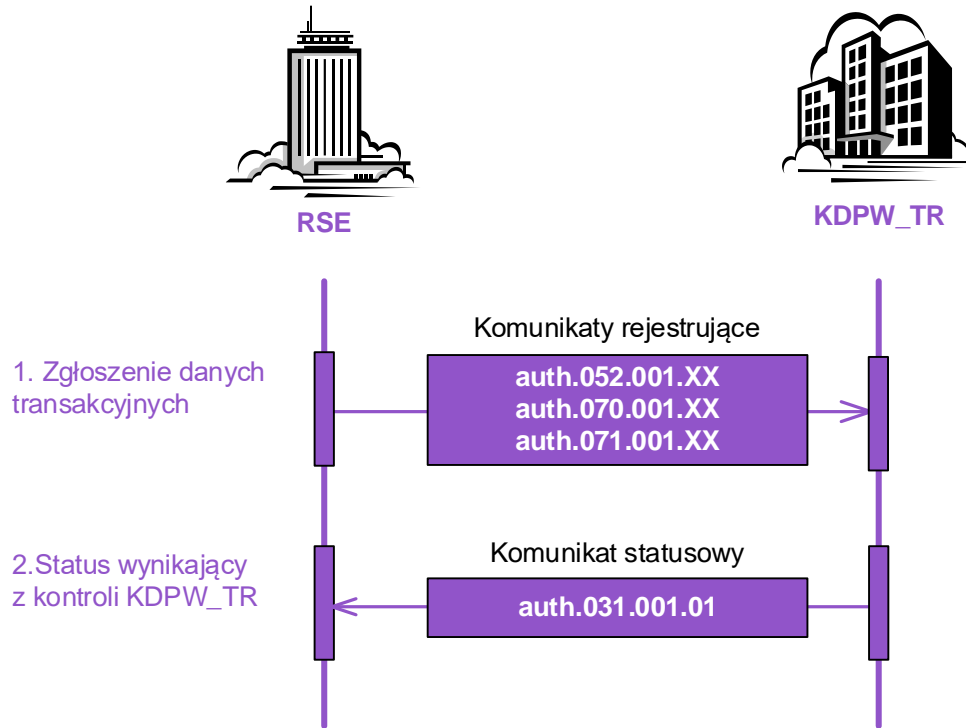
3.3.1. **OrgnlRcrdId** wskazywany jest TechnicalRecordId podany w komunikacie wejściowym.

3.3.2. **Sts** – status wynikający z kontroli merytorycznej komunikatu dziedzinowego

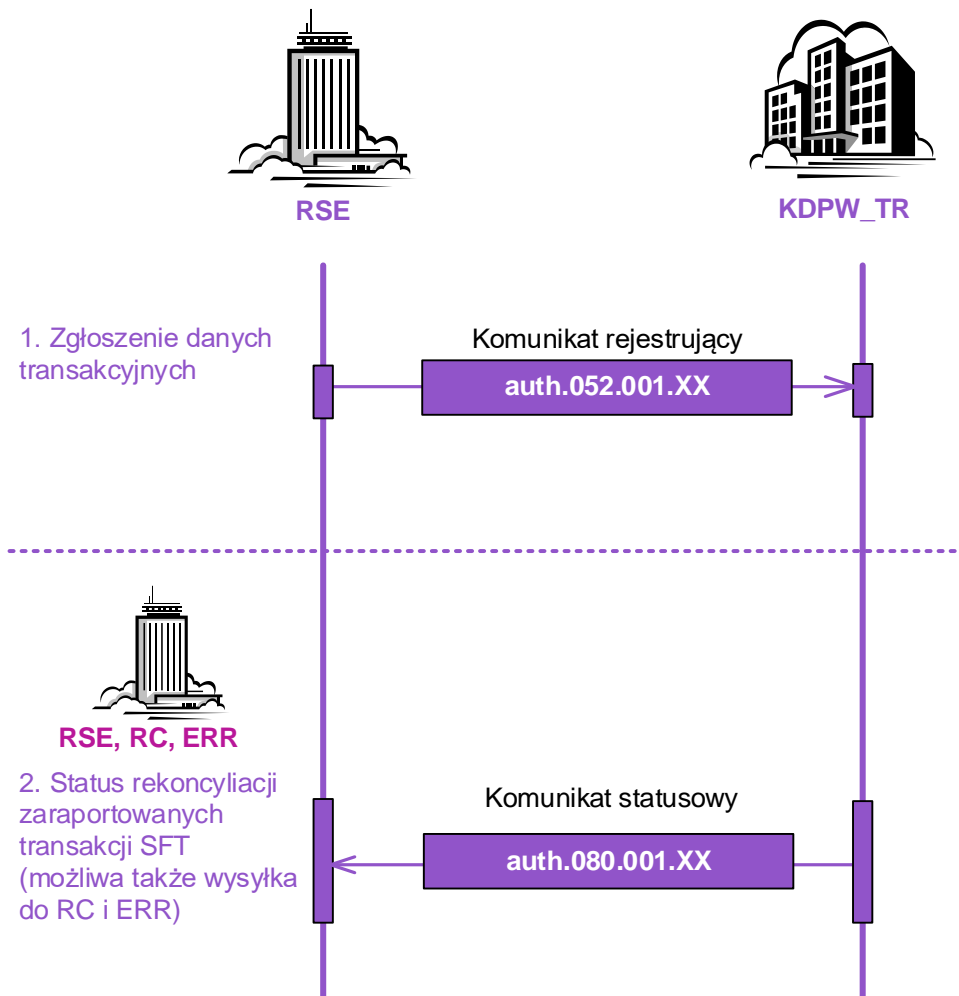
3.3.3. **VldtnRule** – przyczyna odrzucenia w przypadku statusu RJCT

3. Przepływy komunikatów podczas raportowania szczegółów transakcji oraz zdarzeń związanych z transakcjami SFT.

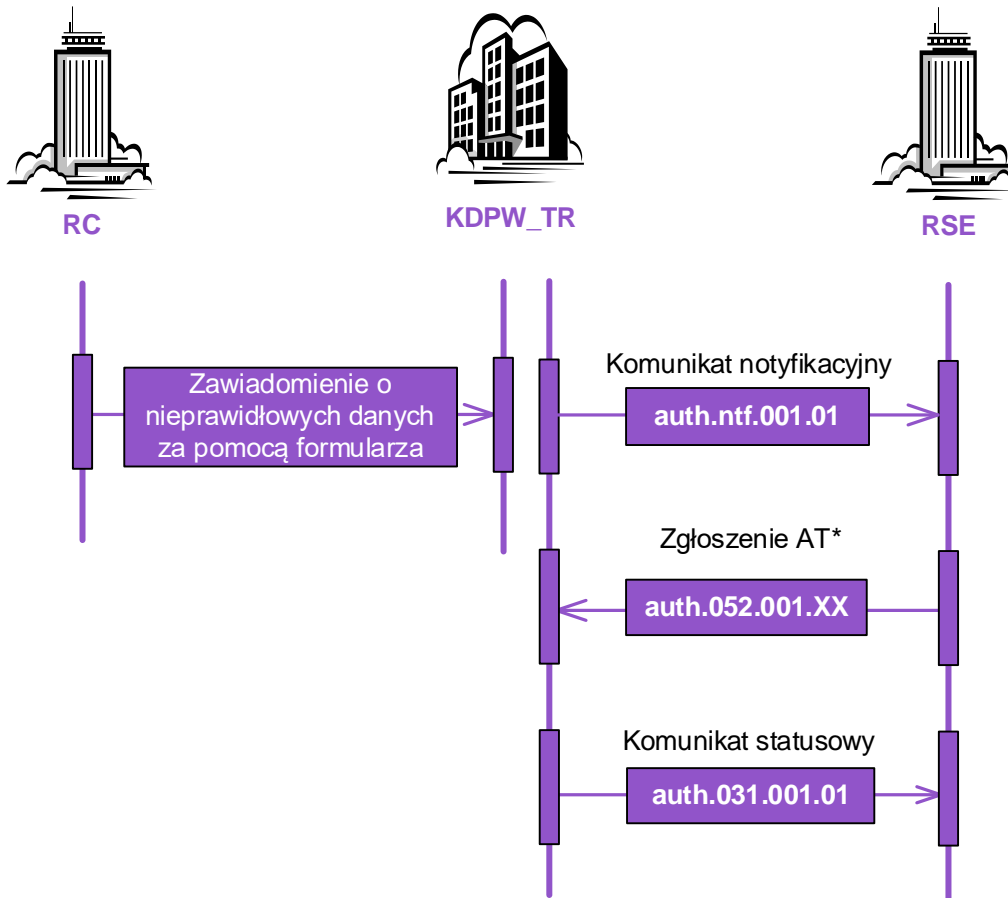
3.1. Raportowanie transakcji i zdarzeń



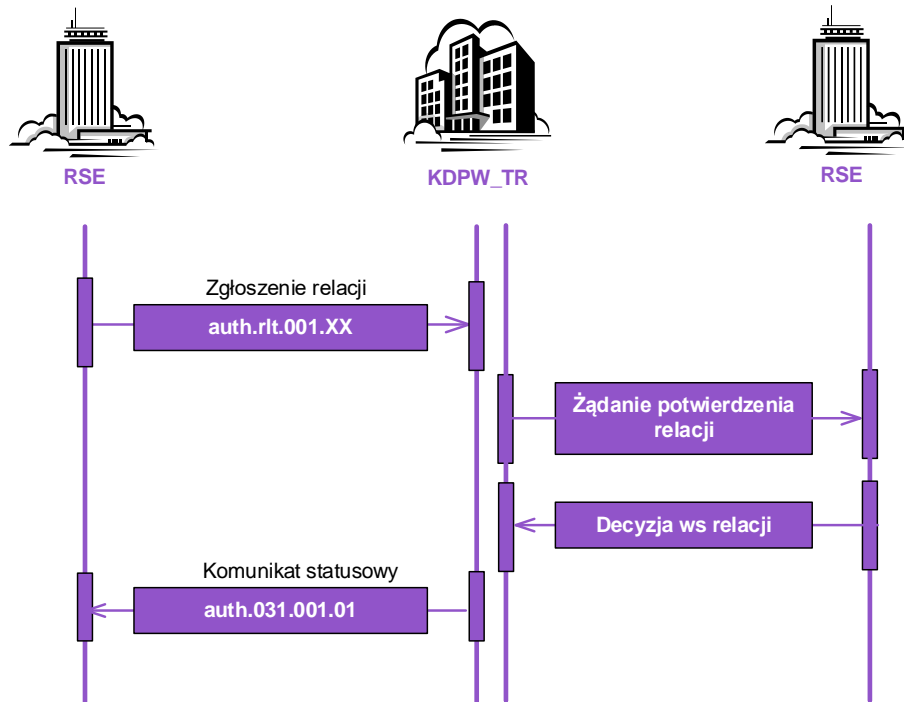
3.2. Przekazywanie wyników rekonyliacji



3.3. Komunikat notyfikacyjny (zgłoszenie przez RC błędu w raporcie)



3.4. Definiowanie relacji w bazach Repozytorium





3.5. Raporty końca dnia

