

KDPW_TR (Registrul Central de Tranzacții)

Kinga Pełka – Specialist Senior KDPW_TR

București, 26.05.2015

■ Raportare către KDPW_TR

- Comunicarea cu KDPW_TR (instrumente, comunicate xml)
- Mediul de lucru
- Mentenanță, confidențialitate și accesul la date
- Reconciliere

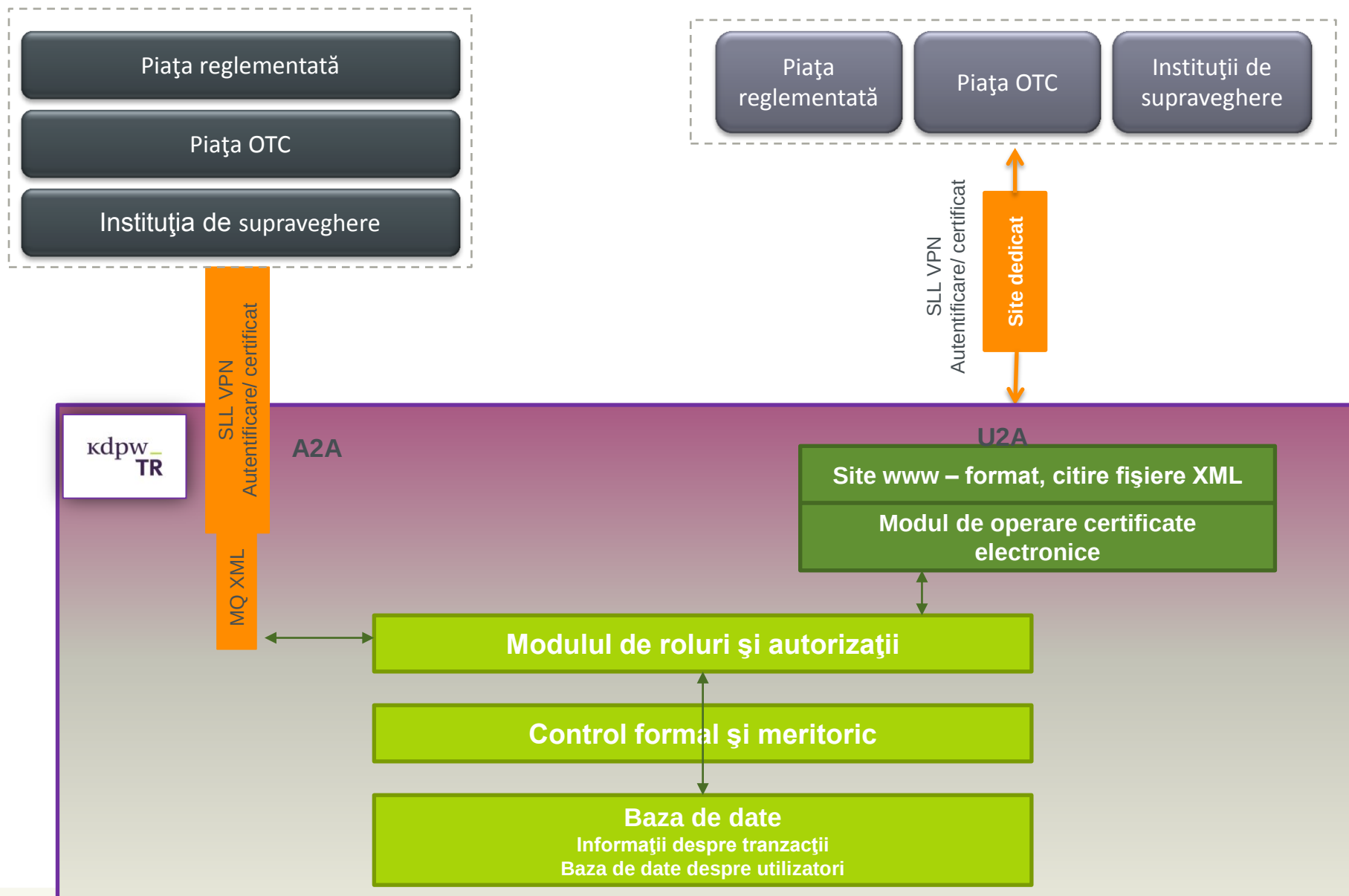
■ Participare în KDPW_TR

- Informații despre participanții KDPW_TR
- KDPW_TR în cifre

■ Tarife KDPW_TR

Raportare către KDPW_TR

Concepția generală a sistemului de gestionare a registrului central de tranzacții



- KDPW_TR posedă următoarele **medii de lucru** disponibile pentru utilizatorii externi:
 - **Mediul PRD** – mediul de producție - disponibil doar pentru participanții KDPW_TR și entitățile autorizate.
 - **Mediul de testare TSTA** – mediu de testare care este conform cu mediul PRD.
 - **Mediul de testare TSTB** – mediu de testare utilizat pentru efectuarea de teste pentru noile funcționalități și soluții.
- **Medii de testare KDPW_TR general disponibile** – indiferent de relația cu KDPW_TR.
- Mediile de testare sunt disponibile **gratuit**.

Pentru a asigura siguranța datelor transmise între aplicația participantului și aplicația KDPW_TR, au fost utilizate următoarele mecanisme:

- Confidențialitatea și integritatea de transmisie a datelor datorită tehnologiei de tunelare.
- În cadrul accesării U2A și A2A prin serviciile web se folosesc certificatele SSL ale site-ului. În cadrul accesării U2A și A2A prin serviciile MQ se utilizează un tunel VPN.
- Autorizarea și controlul accesului către fiecare funcționalitate are loc prin autorizațiile definite în modulul de roluri și autorizații.

U2A (User to Application):

- interfața grafică a utilizatorului care suportă schimbul manual de date cu aplicația Registrului Central de Tranzacții
- este realizat în baza aplicației disponibile de la nivelul site-ului KDPW, permite realizarea următoarelor funcționalități:
 - înregistrarea unei singure tranzacții prin format,
 - înregistrarea multor tranzacții, în cadrul comunicatului definit în format XML,
 - gestionarea certificatelor digitale
 - modificarea, ștergerea și vizualizarea tranzacțiilor înregistrate, în conformitate cu autorizațiile acordate,
 - descărcarea rapoartelor predefinite și a datelor agregate,
 - selectarea datelor pentru pregătirea rapoartelor proprii.
- interfața utilizatorului este disponibilă prin intermediul browserului

Trade Repository (PRD)

Current date and time: Thu May 21 12:12:08 UTC+0200 2015

Eligibility: 21/05/2015

Welcome, Kinga Pelka KDPW S.A. PL5261009528

The certificate is valid until: 2017-01-22 07:51

logout >>

XML file import Reporting service Searching and reports download Archive TR Communication Requested Data

(c) KDPW 2013

Import XML file

Browse...

Import

Registration

General information

Counterparty information

Valuation and collateral information

Trade details

Trade ID Transaction Reference Number

Previous trade ID

Trade Detailed Information

Venue of execution Compression

Front Up Payment Delivery Type

Master Agreement Version Master Agreement Type

Execution Timestamp Effective Date

Maturity Date Termination Date

Settlement Date Price/Rate

Price Notation Notional Amount

Price Multiplier Quantity

Risk Mitigation

Confirmation Timestamp Confirmation Means

Contract Type

A2A (Application to Application):

- Interfața care suportă schimbul automat de date dintre aplicația RT de partea KDPW și aplicația Participantului RT.
- Este realizat prin schimbul de comunicate definite în format XML cu ajutorul programului IBM WebSphere MQ.
- Pe site-ul KDPW în submeniul Registrul Central de Tranzacții EMIR este publicat documentul care definește parametrii conexiunii de comunicare. Celelalte informații sunt transmise după cererea de acces A2A către mediul Registrului Central de Tranzacții.

Pentru a comunica cu aplicația care gestionează registrul central de tranzacții **KDPW_TR utilizează propriile comunicate XML**. Structura comunicatelor și dicționarele cu valorile posibile sunt disponibile pe internet.

Schimbul de comunicate XML este gratuit.

Participanților noștri le asigurăm posibilitatea de utilizare a comunicatului de bază (trar.ins.001.01), datorită căruia pot transmite rapoarte cu toate tipurile de modificări, precum și cu seria de comunicate colective care facilitează raportarea modificărilor, actualizarea evaluării și a protecției, precum și terminarea anterioară.

În fiecare etapă a comunicării **KDPW_TR nu folosește comunicate SWIFT.**

- **Comunicate utilizate pentru depunerea de rapoarte:**
 - Comunicat de **bază** trar.ins.001.01
 - ✓ raportarea de noi tranzacții
 - ✓ raportarea de modificări pentru raportul depus anterior
 - Comunicate **colective** (utilizate raportarea modificărilor la rapoartele depuse)
 - ✓ trar.ins.002.01 - raportare colectivă a evaluării
 - ✓ trar.ins.003.01 - raportare colectivă a protecțiilor
 - ✓ trar.ins.004.01 - raportare colectivă a terminării instrumentului financiar/poziției
 - ✓ trar.ins.005.01 - raportare colectivă pentru modificarea datelor contrapărții
- **Comunicat de întrebare** - trar.rqs.001.01
- **Comunicate retur:**
 - trar.sts.001.01 - comunicat cu status de înștiințare
 - trar.sts.002.01 - comunicat cu status de prelucrare a comunicatului
- **Comunicat despre discrepanțele dintre rapoarte** - trar.rcn.001.01
- **Comunicatul utilizat pentru publicarea de date agregate** – trar.ifr.001.01
 - poate fi descărcat de pe site-ul [www](http://www.kdpw.ro)

Accesul la datele despre contractul derivat îl posedă doar:

- contrapartea, dacă este participant la registrul central de tranzacții
- participantul la registrul central de tranzacții care raportează contracte în numele contrapărții
- entitatea care posedă status KUR
- organul autorizat să acceseze informații despre contractele derivate conform cu art. 81 par. 3 din Regulamentul EMIR (de ex. KNF, ESMA, băncile centrale).

Acces on-line:

- Rapoarte curente active. Informațiile cumulate în registrul central de tranzacții KDPW sunt disponibile on-line pentru toate contractele la termen active.
- Rapoartele terminate. În caz de expirare a instrumentului tranzacțiile sunt disponibile direct timp de 30 de luni de la data încetării contractului.

Acces off-line:

- Registrul central de tranzacții asigură accesul la datele din arhivă la cererea unei entități abilitate.
- Cererile sunt soluționate de către Operatorii RT în termen de max. 5 zile lucrătoare.
- Rapoartele sunt depozitate în arhivă pe o perioadă între 30 de luni până la 10 ani de la data încheierii contractelor.

Registrul Central de Tranzacții verifică:

- concordanța datelor cu formatul stabilit de către RTS/ITS EMIR (respingerea raportului)
- depunerea la termen a rapoartelor
- concordanța datelor în rapoartele privitoare la tranzacția în cauză transmise de ambele părți separat. În cadrul verificării concordanței datelor distingem două etape:
 - potrivirea rapoartelor - căutarea unui raport depus de contrapartidă
 - compararea rapoartelor – compararea detaliilor tranzacțiilor

Registrul Central de Tranzacții nu verifică:

- corectitudinea meritorică a datelor raportate
- concordanța cu starea de fapt a datelor raportate

În afară de câmpurile (datele) care decurg direct din regulament, fiecare RT are dreptul de a introduce câmpuri adiționale, iar verificarea acestora se va efectua în conformitate cu liniile directoare acceptate de registrul în cauză.

Atenție! *TR nu este entitatea abilitată să interpreteze prevederile legale, atât în aspectul subiectiv cât și obiectiv de aplicare al acestora.*

Reconciliere

Contrapărțile contractelor la termen supuse obligativității de raportare sunt obligate să cadă de acord cu privire la detaliile tranzacției în baza standardelor tehnice publicate.

Registrul central de tranzacții KDPW_RT, împreună cu alte registre centrale de tranzacții, sprijină acest proces potrivit și comparând rezultatele tranzacțiilor raportate de către părți separat. În cazul în care se constată neconcordanțe, participanții care raportează obțin un comunicat cu codul de eroare, care indică câmpul ce conține neconcordanța.

Verificarea concordanței detaliilor tranzacției este realizată în două etape. În primul pas se realizează potrivirea rapoartelor care constă în căutarea unui raport depus de contrapartidă.

Potrivirea presupune corelarea a două rapoarte în baza Trade ID care trebuie să fie unic pentru perechea de cotrapărți care posedă coduri LEI.

Potrivirea și compararea cuprinde:

- rapoarte depuse unilateral către KDPW_TR de ambele contrapartide;
- rapoartele depuse unilateral, în care doar o contrapartidă raportează către KDPW_TR, iar cea de-a doua contrapartidă are obligația de raportare și raportează la un alt TR; și
- rapoarte depuse biilateral către KDPW_TR în numele ambelor contrapartide de către un Participant raportor;

Potrivirea și compararea nu cuprinde:

- rapoartele depuse unilateral către KDPW_TR din conținutul cărora reiese că cea de-a doua contrapartidă nu are obligația de raportare, deoarece este:
 - ✓ o contrapartidă din afara SEE - <NonEEACtrPty>; sau
 - ✓ o persoană fizică care nu prestează activitate comercială - <OthrCtrPtyInd>.

În comunicatul de reconciliere KDPW_TR în format XML participantul obține statusul tranzacției depuse, iar în caz de eroare de asemenea valorile neconforme raportate de ambele contrapartide ale tranzacției.

În cazul în care tranzacția și toate datele acesteia sunt potrivite și comparate, participantul raportor primește un comunicat cu statusul MACH (matched).

În cazul în care nu se găsește raportul celei de-a doua contrapartide, participantul raportor obține un comunicat cu statusul NPAR (not paired).

În cazul în care raportul celei de-a doua contrapartide este disponibil, însă datele tranzacției diferă, participantul raportor primește un comunicat cu statusul ERRO (error).

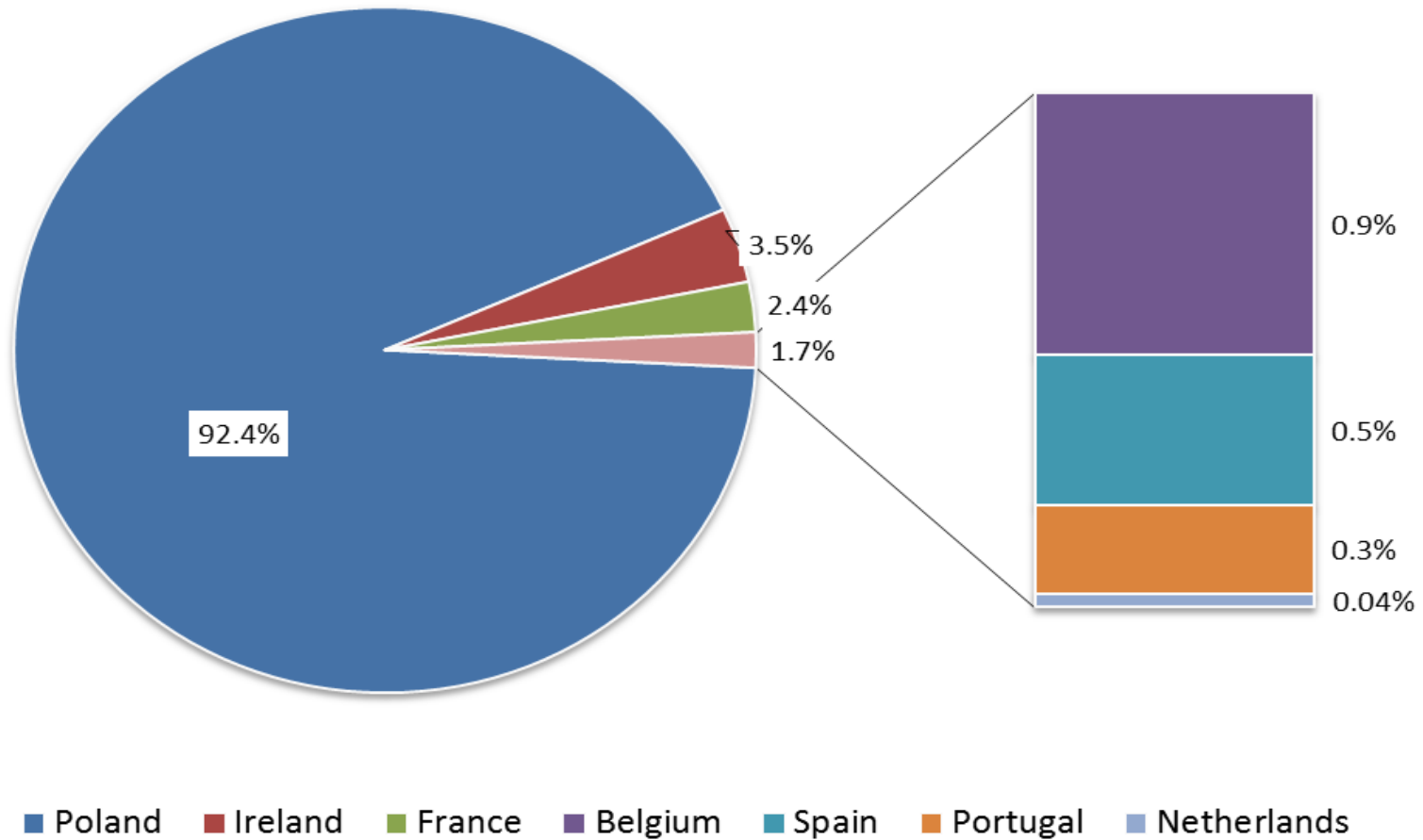
Următoarea etapă este compararea datelor după potrivirea reușită. Există două categorii de câmpuri comparate. Rapoartele în care pe durata comparării rapoartelor potrivite s-au constatat erori din categoria 1 sunt marcate cu statusul ERR1. Rapoartele în care pe durata comparării rapoartelor potrivite s-au constatat erori din categoria 2 sunt marcate cu statusul ERR2.

În ambele cazuri participantul raportant primește un comunicat cu informația despre codul de eroare din categoria 1 sau categoria 2.

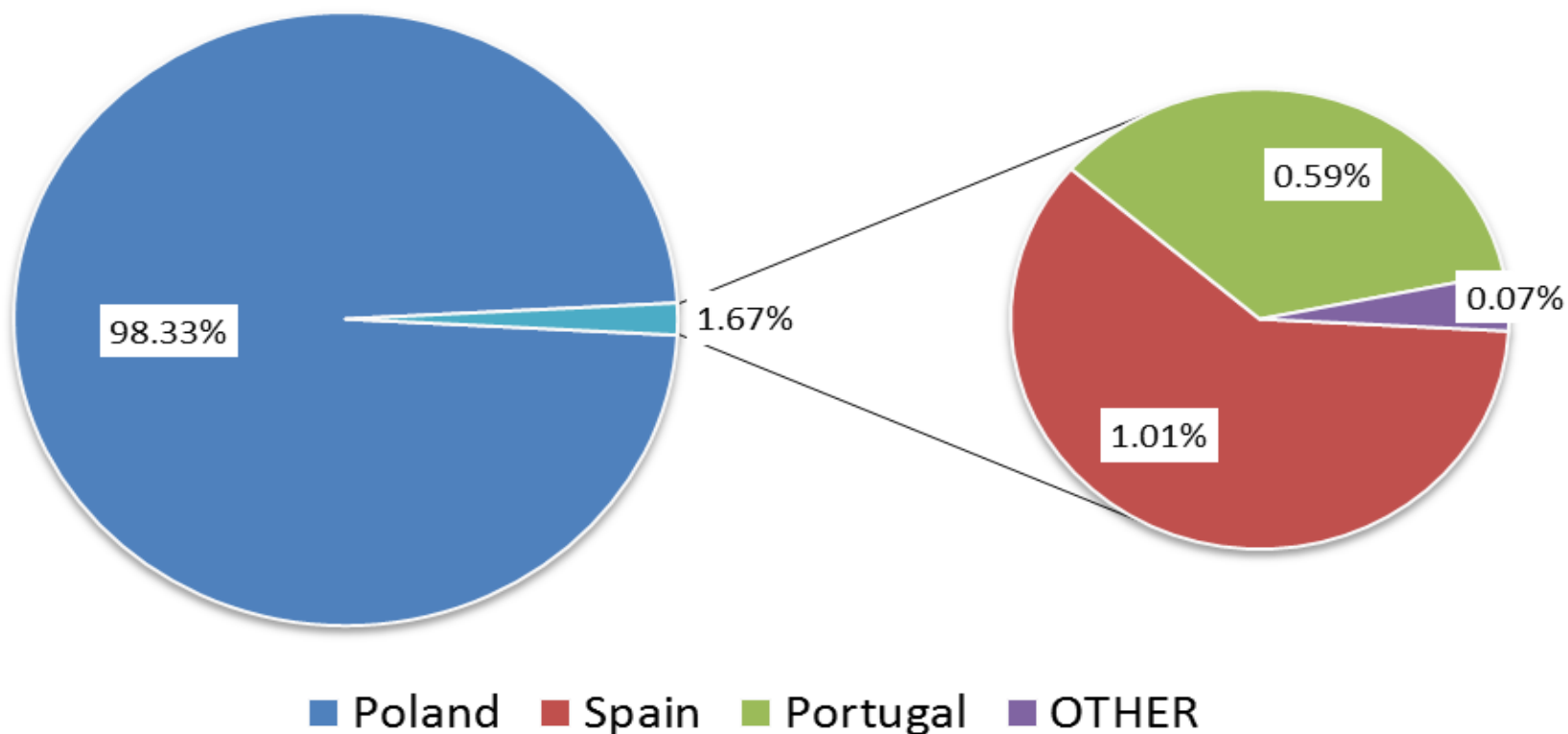
Codurile statusului pentru comunicatul trar.rcn.001.01 și lista întreagă de câmpuri comparate sunt disponibile pe site-ul KDPW.

Participare în KDPW_TR

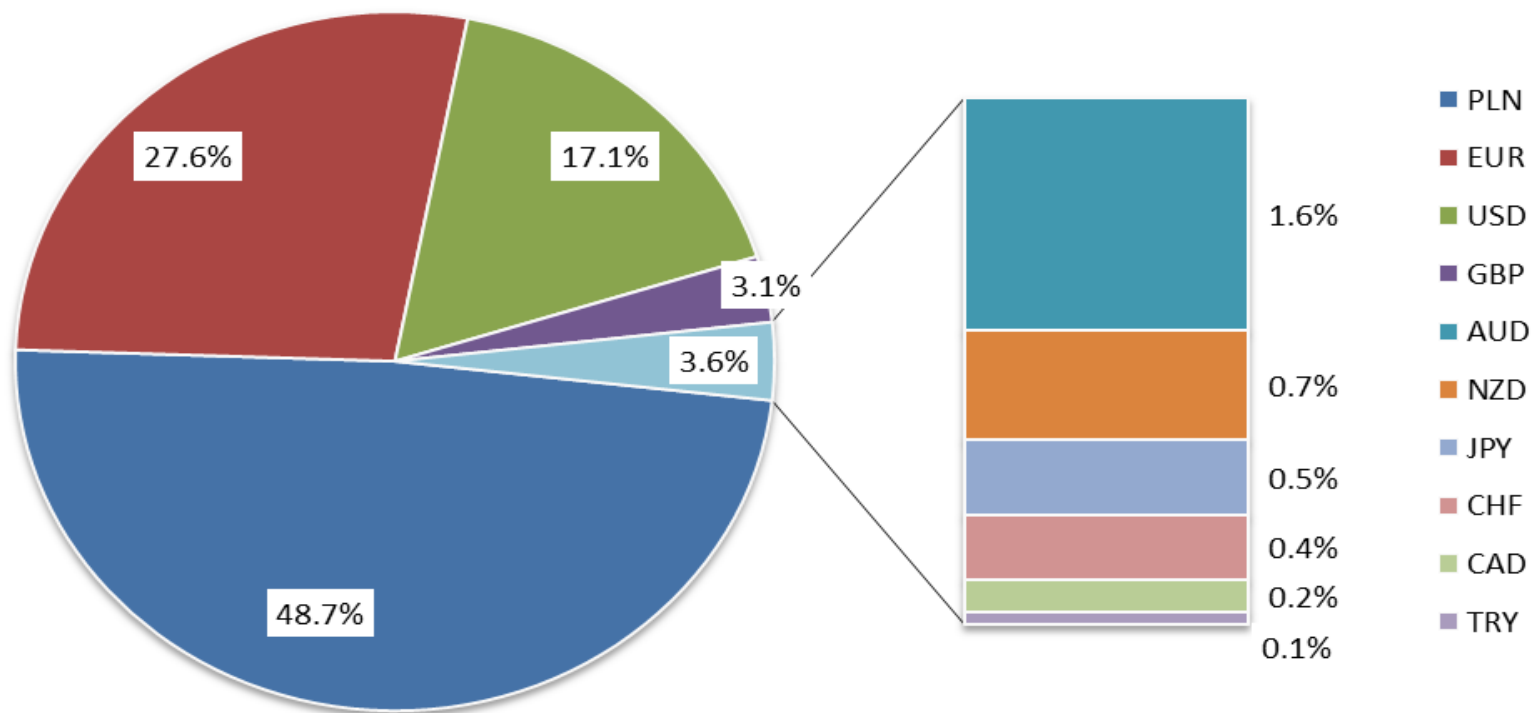
Number of Transactions by CP Country

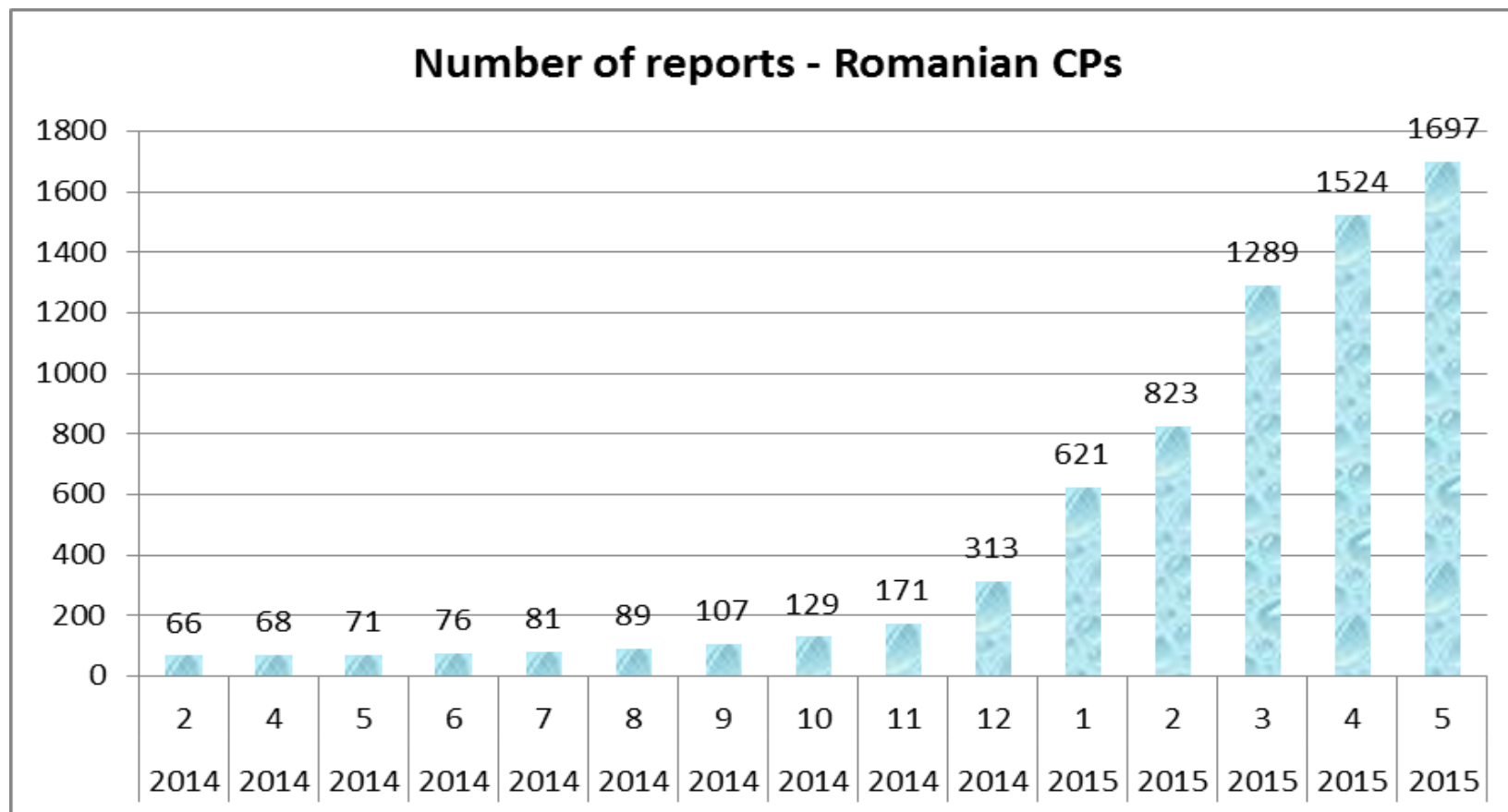


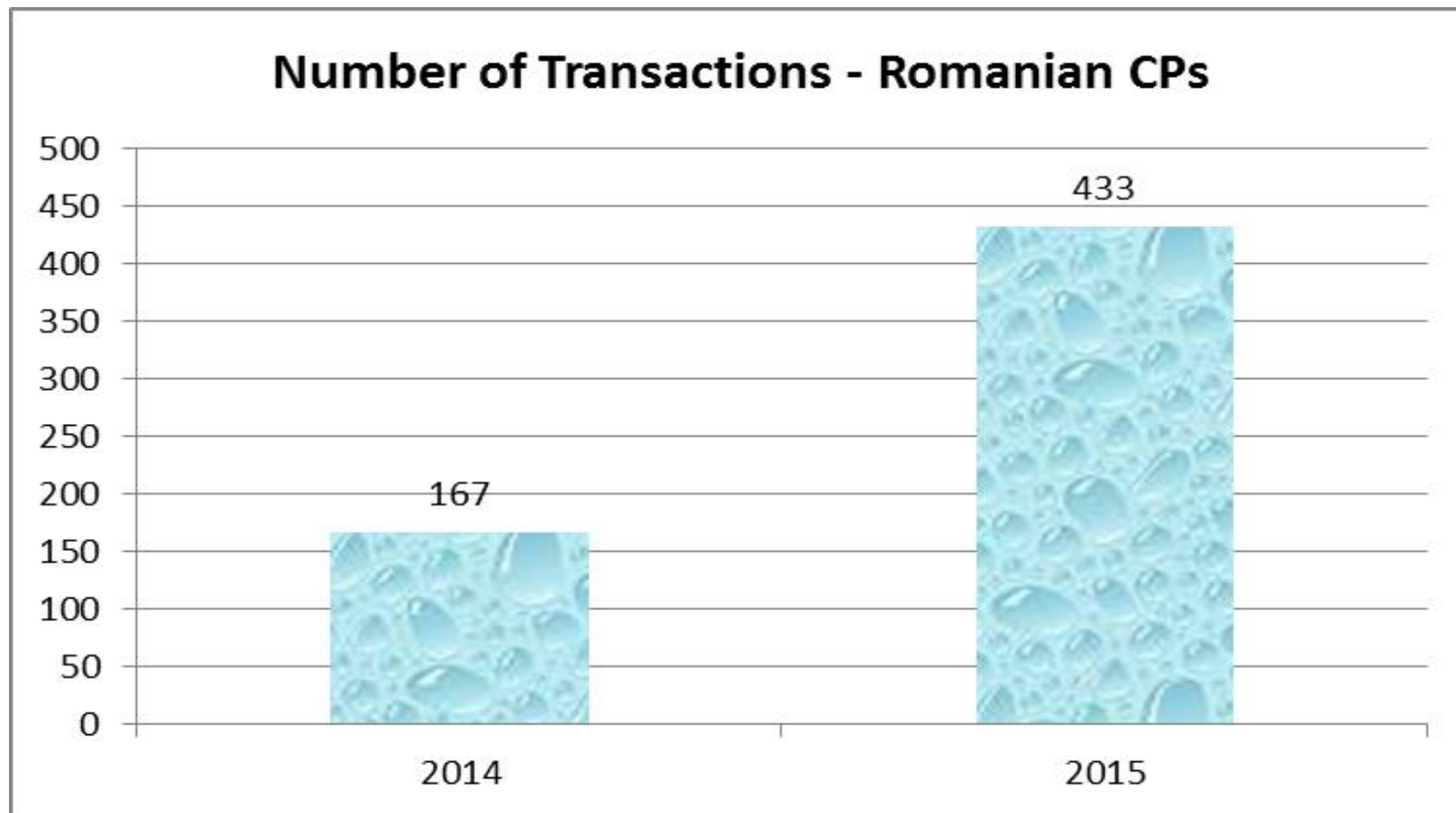
OTC transactions by CP Country



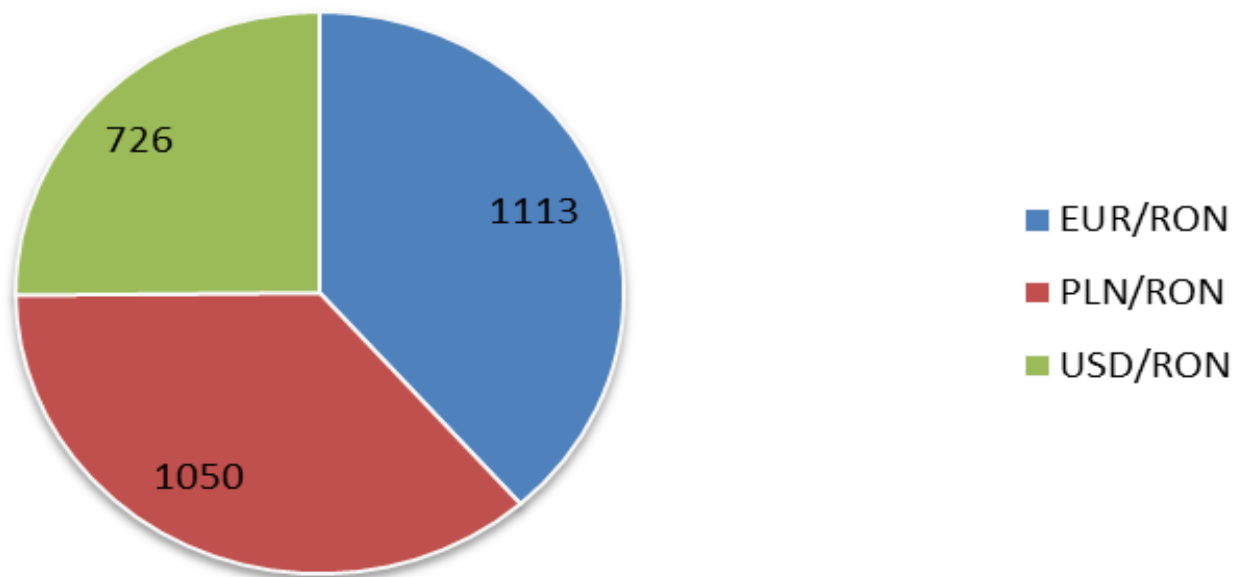
Number of Transactions by Notional Currency



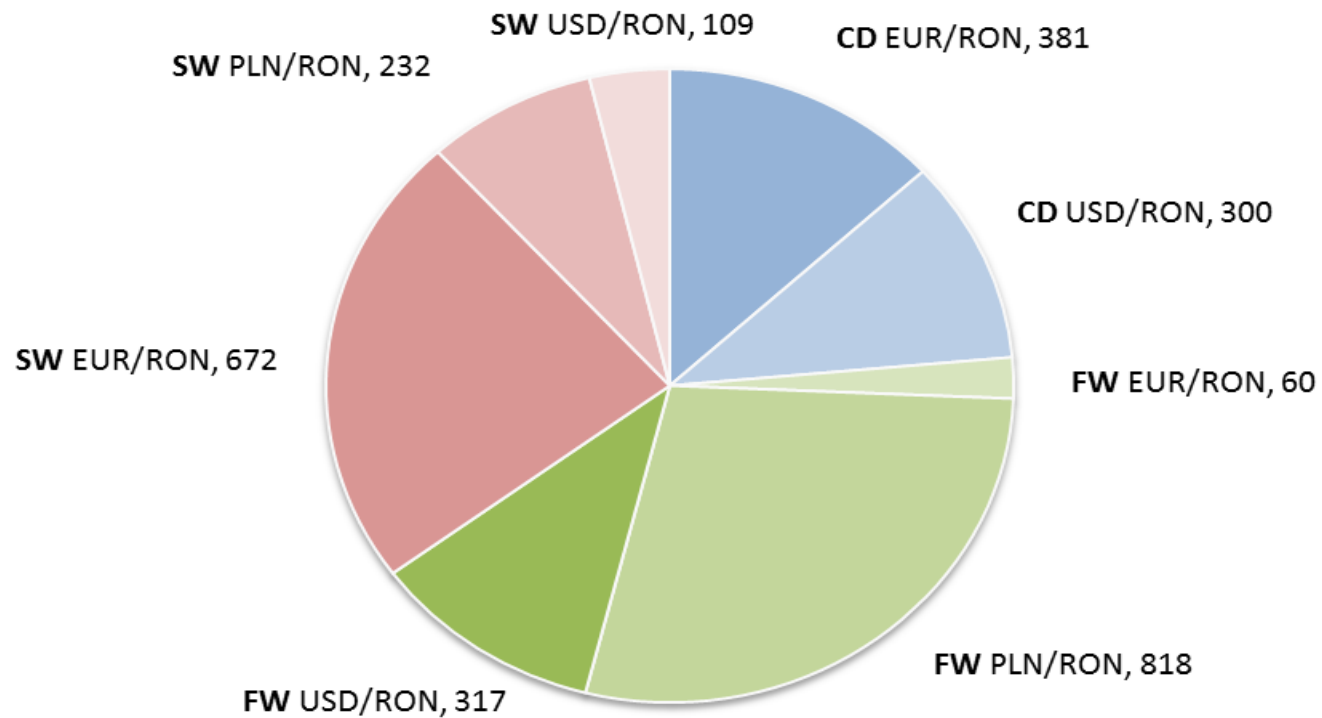




Derivatives in RON - Number of transactions



Derivatives in RON - Number of transactions by contract type



Participanți raportori:

- Participant General Raportori (PUR)
- Participant Ordinar Raportor (POR)

Participanți intermediari:

- Participant Intermediar la Registru (PIR)

Alți utilizatori:

- Utilizatori Comerciali ai Registrului (UCR)
- Organe de supraveghere (de ex. KNF, ESMA, băncile centrale).

- **Există posibilitatea de delegare a raportării către o altă entitate:**
 - contrapartida tranzacției
 - către o parte terță

- **Nu există limite privitoare la statusul/locul de stabilire a entității raportoare**

- **În ciuda delegării responsabilitatea pentru raportare revine în continuare părții tranzacției**
 - responsabilitatea pentru transmiterea corectă și la termen a raportului
 - responsabilitatea pentru corectitudinea meritorică a datelor

Participantul General Raportori (GUR):

- transmite către registrul central de tranzacții rapoarte despre contracte în nume propriu sau în numele altei contrapărți, inclusiv rapoartele despre contractele ale căroră acest participant nu este parte;
- posedă acces la datele referitoare la contractele derivate, care au fost transmise de către acest participant sau la care este contrapartidă;
- are posibilitatea de a corecta rapoartele referitoare la contractele la care este contraparte.

Participant Ordinar Raportor (ZUR):

- transmite către registrul central de tranzacții rapoarte despre contracte în nume propriu, precum și în numele contrapărții care este contrapartida tranzacției proprii a acestui participant;
- posedă acces la datele referitoare la contractele derivate, care au fost transmise de către acest participant sau la care este contrapartidă;
- are posibilitatea de a corecta rapoartele referitoare la contractele la care este contraparte.

Participant Intermediar la Registru (PUR):

- posedă acces la datele referitoare la contractele derivate, la care este parte
- are posibilitatea de a corecta rapoartele referitoare la contractele la care este parte

Utilizator Comercial al Registrului (KUR):

- entitatea utilizatoare a registrului autorizată de participant care posedă accesul la informații despre contractele derivate a căror parte este participantul în cauză, în baza contractului de confidențialitate încheiat cu KDPW

UCR obține accesul la informații despre tranzacțiile unei alte entități - doar cu acordul acesteia.

Funcționalitate utilă - de ex. pentru consultanți.

1. Depuneți la KDPW cererea de semnare a unui contract de participare la registrul central al tranzacțiilor

2. Anexe necesare pentru cerere

3. Încheierea contractului cu KDPW

4. Descărcarea certificatelor

Tarife KDPW_TR

- Tabelul cu Tarifele KDPW TR este stabilit în Regulamentul KDPW TR.
- Tarifele pot fi împărțite în:
 - tarife pentru participare - anuale;
 - tarife pentru raportarea tranzacției în registrul central de tranzacții;
 - tarife pentru mentenanța de informații despre tranzacții;
 - alte tarife.
- **Certificatele (U2A și A2A) sunt gratuite** pentru participanții KDPW_TR, însă numărul de certificate nu poate fi limitat.
- **Se percep tarife doar pentru AT=N.**
- **Schimbul de comunicate XML este gratuit.**
- **Toate modificările din rapoarte (modificări, reevaluare etc.) sunt gratuite.**

Tarif pentru participare (anuale) *			Alte tarife
Participanți raportori		Participanți intermediari	Alți utilizatori
POR	PGR	PIR	PCR **
10 000 PLN (cca. EUR 2 380, cca. RON 10 987)	40 000 PLN (cca. EUR 2 380, cca. RON 43 949)	2 000 PLN (cca. EUR 470, ca. RON 2 197)	1 000 PLN (cca. EUR 240, ca. RON 1 099)

* În cazul în care acest contract va fi încheiat în al doileasemestru din anul calendaristic, atunci plata pentru acest an se percepe în ½ din valoare.

** Tariful anual pentru emiterea și mentenanța certificatului (tariful nu este perceput de la participanții Registrului Central de Tranzacții)

Tarif pentru raportarea tranzacției:

Piața reglementată

0,05 PLN
(cca. 0,01 EUR,
ca. 0,0549 RON)

Piața extrabursieră

0,15 PLN
(cca. 0,03 EUR,
ca. 0,16 RON)

Max. 250.000 PLN/rok
(cca. 60.000 EUR, cca.
274.000 RON), dacă ≤ 25
mln contracte raportate
pentru contrapartea
respectivă

Tariful pentru menținerea de informații despre tranzacții:

Menținerea informației în registrul central de
tranzacții:

0,05 PLN (cca. 0,01 EUR, cca.
0,0549 RON)/tranzacție

Garantăm reduceri de prețuri odată cu creșterea volumului de raportări.

Vă mulțumesc pentru atenție!

Kinga Pełka

Specialist Senior KDPW_TR

Contact:

E-mail: repository@kdpw.pl

Telefon:

Registrul Central de Tranzacții + 48 22 537 91 47, + 48 22 537 95 72

www.kdpw.pl