

SDAT – sběr dat



Říjen 2014

**© ZHOTOVITEL Czech s.r.o.**, Všechna práva vyhrazena

Říjen 2014

**© ZHOTOVITEL Czech s.r.o.**, Všechna práva vyhrazena

Říjen 2014

**© ZHOTOVITEL Czech s.r.o.**, Všechna práva vyhrazena

**SDAT – nová podoba metodiky vykazovacího rámce MKT**

***Verze: 1.1***

**Identifikace dokumentu**

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |
| Název dokumentu: | **SDAT – nová podoba metodiky vykazovacího rámce MKT** |
| Verze dokumentu: | **1.1** |
| Projekt:  | **SDAT – sběr dat** |
| Autor: | **NESS Czech s.r.o.**, ČNB |

**Historie dokumentu**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Datum** | **Verze** | **Popis verze a změn oproti verzi předchozí** |
| 2020-10-06 | 1.0 | Úvodní verze dokumentu |
| 2021-05-24 | 1.1 | Zavedena povinnost formátu ISO 20022 pro výkazy TRAFIM10 a TRAFIM20 (kap. 6.3.1 a kap. 7.3) |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**Obsah**

[1. Úvod 4](#_Toc52888418)

[1.1. Účel a obsah dokumentu 4](#_Toc52888419)

[1.2. Pojmy a zkratky 4](#_Toc52888420)

[2. Typy výkazů 6](#_Toc52888421)

[2.1. Úvod 6](#_Toc52888422)

[2.2. Statistický výkaz 6](#_Toc52888423)

[2.3. Transakční výkaz 6](#_Toc52888424)

[2.4. Číselníkový výkaz 7](#_Toc52888425)

[3. Technické a transakční parametry 8](#_Toc52888426)

[3.1. Technické parametry 8](#_Toc52888427)

[3.2. Transakční parametry 9](#_Toc52888428)

[4. Typy datových oblastí 10](#_Toc52888429)

[4.1. Úvod 10](#_Toc52888430)

[4.2. Transakční – hlavní 10](#_Toc52888431)

[4.3. Transakční – zrušené transakce 10](#_Toc52888432)

[4.4. Transakční – detail 11](#_Toc52888433)

[4.5. Číselníková – hlavní 11](#_Toc52888434)

[4.6. Číselníková – detail 11](#_Toc52888435)

[5. Kontroly 12](#_Toc52888436)

[5.1. Úvod 12](#_Toc52888437)

[5.2. Formální kontroly Technických parametrů 12](#_Toc52888438)

[5.3. Závažnost JVK a MVK kontrol 13](#_Toc52888439)

[5.4. Skupiny a pořadí kontrol 13](#_Toc52888440)

[5.5. Podmíněnéspouštění JVK a MVK kontrol 14](#_Toc52888441)

[5.6. Opakované zpracování JVK a MVK kontrol 14](#_Toc52888442)

[5.7. Skupiny MVK 14](#_Toc52888443)

[5.8. Jazyk kontrol 15](#_Toc52888444)

[6. Metodiky MKT 17](#_Toc52888445)

[6.1. Úvod 17](#_Toc52888446)

[6.2. Knihovna 17](#_Toc52888447)

[6.3. Výkazy 17](#_Toc52888448)

[6.4. Jednovýkazové kontroly 25](#_Toc52888449)

[6.5. Mezivýkazové kontroly 26](#_Toc52888450)

[7. Zasílání a zpracování výkazů MKT 29](#_Toc52888451)

[7.1. Úvod 29](#_Toc52888452)

[7.2. Evidence Osob v SDAT 29](#_Toc52888453)

[7.3. Zasílání dat výkazů 29](#_Toc52888454)

[7.4. Zpracování transakčních výkazů 29](#_Toc52888455)

[7.5. Zpracování číselníkového výkazu 33](#_Toc52888456)

[7.6. Zpracování mezivýkazových kontrol 34](#_Toc52888457)

#

# Úvod

## Účel a obsah dokumentu

Dokument obsahuje informace týkající se implementace výkazů MKT v systému SDAT.

Obsahuje základní popis metodických změn výkazů MKT a popis vlastností systému SDAT, které se týkají metodik, sběru a zpracování daných typů výkazů.

Dokument je členěn do následujících kapitol:

* **Typy výkazů** – popisuje zavedení typů Výkazů a jejich základní vlastnosti v systému SDAT za účelem standardizace metapopisu a zpracování typově obdobných dat.
* **Technické a transakční parametry** – popisuje zavedení technických a transakčních Parametrů v systému SDAT a způsob jejich používání.
* **Typy datových oblastí** – popisuje zavedení typů Datových oblastí pro některé typy Výkazů a jejich základní vlastnosti v rámci standardizace metapopisu a zpracování typově obdobných dat.
* **Kontroly** – popisuje nové vlastnosti v oblasti Kontrol, které budou do systému SDAT zavedeny pro potřeby zpracování výkazů MKT a budou obecně použitelné.
* **Metodiky MKT** – popisuje plánované úpravy Metodiky MKT s přechodem sběru výkazů MKT do systému SDAT.
* **Zasílání a zpracování výkazů MKT** – popisuje nové vlastností týkající se zasílání a zpracování dat výkazů v systému SDAT a způsob použití pro výkazy MKT.

V případě dílčích změn v průběhu implementace bude dokument průběžně aktualizován.

## Pojmy a zkratky

V tabulce jsou uvedené zkratky definované ESMA nebo jinou externí institucí (tyto zkratky jsou uvedené v původním jazyce) a interní zkratky používané v ČNB.

|  |  |
| --- | --- |
| Pojen/Zkratka | Popis |
| ARM | Approved Reporting Mechanism |
| CA | Competent Authority  |
| DO | Datová oblast |
| ESMA | European Securities and Markets Authority |
| FIRDS | Financial Instruments Reference Data System |
| IS | Informační systém |
| JVK | Jednovýkazové kontroly |
| LEI | Legal Entity Identifier |
| MiFID | The Markets in Financial Instruments Directive – Směrnice o trzích finančních nástrojů |
| MiFIR | Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 ve znění nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2016/1033. |
| MKT | Metodika Kapitálové trhy |
| MtS | Metainformační systém – zkratka stávajícího systému pro sběr dat MtS-ISL-SÚD-SDNS |
| MVK | Mezivýkazové kontroly |
| RID | Jednoznačný identifikátor (pojem zavedený v systému MtS) |
| SDAT | Nový systém pro sběr dat nahrazující dosavadní systém MtS-ISL-SÚD-SDNS |
| TREM | Transaction Reporting Exchange Mechanism |
| WS | Webová služba |
| XML | eXtensible markup Language |

# Typy výkazů

## Úvod

Vzhledem k tomu, že výkazy ČNB mají určité typové vlastnosti, které jsou charakteristické pro jejich řešení a zpracování, zavádí se v systému SDAT základní typy výkazů statistický, transakční číselníkový s cílem definování jejich typových vlastností a dosažení typového chování.

## Statistický výkaz

**Statistický výkaz** obsahuje data „statistického“ charakteru, která spolu obsahově vzájemně souvisí a jsou vykazována za danou vykazující osobu a rozsah vykazování ke konkrétnímu dni (stav ke dni).

Sledovanou jednotkou dat jsou tedy data za Výskyt výkazu – výkaz , osoba, rozsah vykazování, stave ke dni. Výskyty výkazů jsou zpravidla pravidelně plánovány v určité periodicitě (měsíční, čtvrtletní, roční, denní aj.), v některých případech mohou vznikat i nepravidelně (ad-hoc).

Vykazovací povinnost je splněna, pokud jsou data za plánovaný Výskyt výkazu zaslána a vyhovují všem předepsaným kontrolám.

Data k Výskytu výkazu jsou zasílána ve formě tzv. Vydání výskytu výkazu.

Nad zaslanými daty k Výskytu výkazu jsou provedeny formální/formátové kontroly a jednovýkazové kontroly a pokud jsou zjištěny chyby, jsou data Výskytu výkazu odmítnuta jako celek a vykazující osoba je musí opravit (nebo případně podle závažnosti kontrol potvrdit).

Opravu lze zaslat formou úplné opravy a u některých výkazů i formou tzv. změnové opravy, ve které mohou být zaslány pouze nové, opravené nebo zrušené záznamy proti předchozímu stavu.

Pokud zaslaná data vyhoví formálním/formátovým a jednovýkazovým kontrolám a výkaz nemá předepsané mezivýkazové kontroly, je Výskyt výkazu splněný.

Pokud zaslaná data vyhoví formálním/formátovým a jednovýkazovým kontrolám a výkaz má předepsané mezivýkazové kontroly, je Výskyt výkazu splněný až po úspěšném provedení všech mezivýkazových kontrol a do té doby je považován za předběžně splněný.

Opravy a změny dat lze posílat i k historickým Výskytům výkazů, a to i v případě, že již byly splněné. Zaslání opravy znamená znovu spuštění mezivýkazových kontrol, kterých se daný Výskyt výkazu účastní.

## Transakční výkaz

**Transakční výkaz** obsahuje data o transakcích vykazující osoby, které jsou v rámci výkazu průběžně vykazovány, a to pravidelně (zpravidla denně) nebo nepravidelně (ad-hoc).

I pro transakční výkazy jsou vytvářeny Výskyty výkazů definované výkazem, osobou, rozsahem vykazování a stavem ke dni, ale Výskyt výkazu v podstatě není objektem pro sledování stavu plnění vykazovací povinnosti. Data transakčního výkazu za vykazující osobu jsou konsolidována za výkaz jako celek a vykazovací povinnost je splněna zasláním a akceptací jednotlivých transakcí.

V některých případech mohou být transakce týkající se vykazující osoby zaslány jinou vykazující osobou v rámci jejího Výskytu výkazu (např. data TRAFIM10 může zaslat přímo OCP nebo ARM nebo Obchodní systém).

Výskyty výkazů budou vytvářeny zpravidla ad-hoc až při zaslání dat výkazu za danou vykazující osobu. Naplánování výskytů výkazů a povinné zaslání dat transakčního výkazu za daný den bude však také možné.

Data k Výskytu výkazu jsou zasílána ve formě tzv. Vydání výskytu výkazu. Vykazující osoba může určitý den zaslat i více Vydání výskytů výkazů, v nichž může zasílat přírůstky a opravy dat. Po ukončení dne je však daný Výskyt výkazu uzavřen a další data jsou zasílána k následujícímu Výskytu výkazu.

Nad zaslanými daty Vydání výskytu výkazu jsou provedeny formální/formátové kontroly a jednovýkazové kontroly. V případě výskytu formátových nebo formálních chyb je odmítnuto zaslané Vydání výskytu výkazu jako celek.

V rámci jednovýkazových kontrol jsou samostatně kontrolovány jednotlivé transakce a podle výsledku jsou tyto konkrétní transakce přijaty nebo odmítnuty.

Mohou se vyskytovat kontroly, jejichž výsledek nelze pro určitou transakci v okamžiku zpracování určit, a daná transakce nabývá stavu „pending“. Jedná se o kontroly proti tzv. externím číselníkům (např. číselník instrumentů, denně aktualizovaný ze zdroje ESMA) a po jejich aktualizaci jsou dané kontroly nad danými transakcemi spuštěny opakovaně.

Opravy nebo změny transakcí jsou zasílány v rámci navazujících Vydání výskytu výkazu bez ohledu na Výskyt výkazu, tzn. že mohou být zaslány ve stejný nebo kterýkoli následující den. Jedná se tedy o určitý typ změnové opravy, pro který je používán technický parametr T0024.

I pro transakční výkazy mohou být předepsány mezivýkazové kontroly, zpravidla vůči číselníkovým výkazům nebo jiným transakčním výkazům. V případě zjištění chyb je třeba opravit příslušné chybové transakce nebo záznamy číselníkových výkazů.

Specifickou vlastností transakčních výkazů je možnost zaslání transakcí týkající vykazující osoby v rámci výskytu jiné vykazující osoby nebo dokonce v rámci jiného výkazu. V mezivýkazových kontrolách tak mohou být prováděny kontroly mezi daty zaslanými v rámci Výskytů výkazů různých vykazujících osob.

## Číselníkový výkaz

**Číselníkový výkaz** obsahuje data o určité entitě, ve vazbě na vykazující osobu, která se v ČNB používají k vytvoření konsolidovaného „Číselníku“. Tento „Číselník“ se následně používá v kontrolách dat jiných výkazů (zpravidla transakčních) dané vykazující osoby.

I pro číselníkové výkazy jsou vytvářeny Výskyty výkazů definované výkazem, osobou, rozsahem vykazování a stavem ke dni, ale Výskyt výkazu v podstatě není objektem plnění vykazovací povinnosti. Data číselníkového výkazu za vykazující osobu jsou z hlediska času konsolidována za výkaz jako celek a vykazovací povinnost je splněna zasláním záznamů číselníkového výkazu („Položek číselníku“) tak, aby tato data byla možné používat pro mezivýkazové kontroly jiných výkazů.

Výskyty výkazů budou vytvářeny zpravidla ad-hoc, až při zaslání dat výkazu za danou vykazující osobu. Naplánování výskytů výkazů a povinné zaslání dat transakčního výkazu za daný den bude však také možné.

Data k Výskytu výkazu jsou zasílána ve formě tzv. Vydání výskytu výkazu. Vykazující osoba může určitý den zaslat i více Vydání výskytů výkazů, v nichž může zasílat přírůstky a opravy dat. Po ukončení dne je však daný Výskyt výkazu uzavřen a další data jsou zasílána k následujícímu Výskytu výkazu.

Nad zaslanými daty Vydání výskytu výkazu jsou provedeny formální/formátové kontroly a jednovýkazové kontroly. V případě výskytu formátových nebo formálních chyb je odmítnuto zaslané Vydání výskytu výkazu jako celek.

V rámci jednovýkazových kontrol jsou samostatně kontrolovány jednotlivé „Položky číselníku“ a v případě zjištění chyby je příslušná „Položka číselníku“ odmítnuta.

Pro potřeby kontrol není sledována časová platnost „Položek číselníku“ a dalších informací, které jsou k jednoznačnému klíči vykazovány. Všechny změny automaticky zneplatní předchozí údaje k dané „Položce číselníku“. Kontroly vždy probíhají vůči platným údajům k „Položce číselníku“.

# Technické a transakční parametry

## Technické parametry

### Úvod

V systému SDAT jsou zavedeny tzv. **Technické parametry**, což jsou parametry, které jsou standardně používány v Datových oblastech, nepopisují však věcný obsah sbíraných dat, ale plní určitou technickou funkci.

Cílem je zajistit jednotné řešení určitých typových vlastností ve všech výkazech.

Aktuálně jsou zavedeny následující Technické parametry.

### T0023 – Status záznamu změnové opravy

Ve statistických výkazech, kde bude možné zasílat opravy formou změnové opravy, bude v Datových oblastech používán dynamický parametr T0023.

Oborem hodnot je číselník BA0377 s položkami:

* S – standardní
* N – nový
* R – oprava
* X – storno

V nových datech nebo úplné opravě bude v dynamických záznamech zasílána hodnota S, v rámci změnové opravy hodnoty N, R nebo X.

V konkrétní Datové oblasti bude parametr T0023 konkretizován na doménu číselníku, která může obsahovat pouze povolené položky. Bude tedy možné změnovou opravu omezit např na hodnoty N, X apod.

### T0024 – Transakční akce

V transakčních výkazech bude v Datových oblastech používán parametr T0024 k identifikaci zaslání záznamu nové transakce, opravy transakce nebo zrušení transakce.

Oborem hodnot je číselník BA1024 s položkami:

* NEWT – nový
* AMND – oprava
* CANC – zrušení

Parametr T0024 může být konkretizován na konstantní hodnotu pro Datovou oblast, pokud tato obsahuje pouze nové nebo opravené nebo zrušené transakce (použito např. ve výkazu TRAFIM10 pro nové a zrušené transakce). V těchto případech se hodnota parametru T0024 nezasílá.

Parametr T0024 může být v Datové oblasti konkretizován také jako dynamický parametr s doménou, obsahující příslušné položky číselníku BA1024 (zatím není použito). V těchto případech bude hodnota parametru zasílána v příslušném dynamickém řádku.

### T0025 – Číselníková akce

V číselníkových výkazech může být v Datové oblasti použit parametr T0025 k rozlišení stornované „Položky číselníku“. Zasílání nových „Položek číselníku“ nebo jejich změn a oprav bude v číselníkových výkazech implicitní (tzn. pokud „Položka číselníku“ s daným klíčem nebyla dosud zaslána, jedná se o novou „Položku číselníku“, a pokud již byla zaslána, jedná se o opravu) a nebude rozlišováno hodnotami technického parametru T0025.

Oborem hodnot je číselník BA1025 s položkami:

* X – storno

Parametr T0025 bude použít pouze v případě, že je povoleno zaslat storno „Položky číselníku“.

Parametr T0025 bude v Datové oblasti konkretizován jako dynamický parametr s doménou obsahující položky číselníku BA1025 = “X“ - storno (např. použito ve výkazu REFFIM10).

### T0019 – Pořadí

Parametr T0019 má více následujících vlastností:

* Používá se k zajištění jednoznačnosti klíče dynamických parametrů v případech, kdy není tato jednoznačnost zajištěna věcnými dynamickými parametry.
* V transakčních výkazech se používá k určení pořadí zaslaných transakcí, kdy je možné k jedné transakci zaslat i více záznamů v jednom Vydání výskytu výkazu. Tyto záznamy transakcí mohou být v jedné nebo více Datových oblastech, které obsahují konkretizaci parametru T0024 a technický parametr T0019 určuje globální pořadí záznamů přes všechny tyto Datové oblasti.
* V transakčních nebo číselníkových výkazech se používá jako technický referenční klíč v Datových oblastech, které obsahují detailní informace k záznamu transakce nebo „záznamu číselníku“, které jsou zaslány v příslušné Datové oblasti s parametrem T0024 nebo T0025.

### T0021 – Pořadí v rámci DO

Parametr T0021 se používá v Datových oblastech společně s parametrem T0019, pokud k jedné hodnotě T0019 může být zasláno více záznamů.

Parametr T0021 tak zajišťuje jednoznačný složený klíč hodnot technických parametrů T0019, T0021.

## Transakční parametry

Parametry definující věcný klíč transakce v transakčních výkazech mají v systému SDAT nastaven typ „Transakční“.

# Typy datových oblastí

## Úvod

V transakčních výkazech se vyskytují následující typy Datových oblastí:

* Hlavní – obsahuje záznamy nových, opravených transakcí
* Zrušené transakce – obsahuje zrušené transakce
* Detail – obsahuje další údaje k transakcím, které jsou zaslané v hlavní Datové oblasti

V číselníkových výkazech se vyskytují následující typy Datových oblastí:

* Hlavní – obsahuje záznamy nových, opravených nebo zrušených „Položek číselníků“
* Detail – obsahuje další údaje k „Položkám číselníků“, které jsou zaslané v hlavní Datové oblasti

## Transakční – hlavní

Tento typ Datové oblasti obsahuje záznamy nových nebo opravených transakcí v transakčním výkazu. Vždy existuje právě jedna Datová oblast tohoto typu.

Datová oblast obsahuje konkretizaci technického parametru T0024, která může být:

* Konstantní – je používáno, pokud jsou v Datové oblasti zasílány pouze nové transakce (např. TRAF10\_11).
* Dynamická – je používáno, pokud jsou v Datové oblasti zasílány nové nebo opravené transakce (např. TRAF30\_11).

Poznámka: Zrušené transakce nejsou v tomto typu Datové oblasti zasílány. Jsou zasílány v samostatné Datové oblasti typu „zrušené transakce“. Toto řešení vychází z již používaného způsobu zasílání transakcí např. ve výkazu TRAFIM10.

Datová oblast obsahuje dynamický technický parametr T0019, který určuje pořadí záznamů transakcí globálně v rámci Datových oblastí typu „hlavní“ a „zrušené transakce“.

* Stejná transakce, tj. kombinace transakčních parametrů, tak může být v rámci Vydání výskytu výkazu poslána i vícekrát, a to v přesně specifikovaném pořadí.

Technické parametry T0024 a T0019 se používají v kontrolách návaznosti záznamů dané transakce.

## Transakční – zrušené transakce

Tento typ Datové oblasti obsahuje záznamy zrušených transakcí a v transakčním výkazu existuje právě jedna Datová oblast tohoto typu, pokud je možné transakce rušit.

Datová oblast obsahuje vždy konstantní konkretizaci technického parametru T0024 = ‘CANC‘ (např. TRAF10\_51).

Datová oblast obsahuje dynamický technický parametr T0019, který určuje pořadí záznamů transakcí globálně v rámci Datových oblastí typu „hlavní“ a „zrušené transakce“.

* Stejná transakce, tj. kombinace transakčních parametrů, tak může být v rámci Vydání výskytu výkazu poslána i vícekrát, a to v přesně specifikovaném pořadí.

Technické parametry T0024 a T0019 se používají v kontrolách návaznosti záznamů dané transakce.

## Transakční – detail

Tento typ Datové oblasti obsahuje doplňující údaje k transakcím zaslaným v Datové oblasti typu „hlavní“ a v transakčním výkazu může existovat 0 až N Datových oblastí tohoto typu.

Datová oblast obsahuje dynamický technický parametr T0019, který plní roli referenčního klíče na záznam transakce v Datové oblasti typu „hlavní“.

Datová oblast může obsahovat dynamický technický parametr T0021, který umožnuje k jedné hodnotě parametru T0019 zaslat více záznamů, které jsou rozlišeny právě hodnotou parametru T0021.

## Číselníková – hlavní

Tento typ Datové oblasti obsahuje záznamy nových, opravených, stornovaných „položek číselníku“ a v číselníkovém výkazu vždy existuje právě jedna Datová oblast tohoto typu.

Datová oblast může obsahovat dynamický technický parametr T0019.

## Číselníková – detail

Tento typ Datové oblasti obsahuje doplňující údaje k transakcím zaslaným v Datové oblasti typu „hlavní“ a v transakčním výkazu může existovat 0 až N Datových oblastí tohoto typu.

Datová oblast obsahuje dynamický technický parametr T0019, který plní roli referenčního klíče na záznam „Položky číselníku“ v Datové oblasti typu „hlavní“.

Datová oblast může obsahovat dynamický technický parametr T0021, který umožnuje k jedné hodnotě parametru T0019 zaslat více záznamů, které jsou rozlišeny právě hodnotou parametru T0021.

# Kontroly

## Úvod

Zatímco u statistických výkazů jsou kontroly vyhodnocovány za celý Výskyt výkazu, který je podle výsledku kontrol splněný nebo ne, pro transakční a číselníkové výkazy platí:

* Transakční výkaz – kontrolovány jsou jednotlivé zaslané Transakce, které jsou podle výsledku kontrol přijaty nebo odmítnuty. Odmítnuté Transakce musí být následně opraveny, kromě případů kdy neměly být původně vůbec nahlášeny a byly vykázány omylem.
* Číselníkový výkaz – údaje číselníkového výkazu se používají v mezivýkazových kontrolách údajů transakčních výkazů. Cílem je proto dosažení úplnosti a správnosti těchto údajů. Kontrolovány jsou jednotlivé „Položky číselníku“, které jsou podle výsledku přijaty nebo odmítnuty. Odmítnuté „Položky číselníku“ musí být následně opraveny, kromě případů kdy neměly být původně vůbec nahlášeny a byly vykázány omylem.

Dále jsou popsány nové vlastnosti kontrol.

## Formální kontroly Technických parametrů

Zavedeny jsou nové formální kontroly Technických parametrů.

**Kontroly technických parametrů T0019 a T0021 ověřující konzistenci dat v rámci Vydání**

Tyto kontroly zajišťují základní konzistenci vazeb záznamů Datových oblastí pro Vydání výskytu výkazu zaslaná ve formátu SDAT, která je ve formátu ISO2002 zajištěna jeho samotnou XML strukturou.

Tyto kontroly v případě chyby způsobí odmítnutí celého Vydání výskytu výkazu.

|  |
| --- |
| Popis kontroly |
| Hodnota parametru T0019 je unikátní v hlavní datové oblasti, případně v hlavní i rušící datové oblasti (pokud existuje) zároveň. |
| Kombinace hodnot parametrů T0019 a T0021 je v datové oblasti unikátní. |
| Pro hodnotu parametru T0019 v doplňkové datové oblasti musí existovat odpovídají hodnota parametru T0019 v hlavní datové oblasti.  |

**Kontroly parametru T0023 ověřující přípustnost záznamu ve změnové opravě**

Tyto kontroly zajišťují návaznost zaslaných záznamů změnové opravy statistického výkazu na aktuální stav dat daného Výskytu výkazu

Tyto kontroly v případě chyby nezpůsobí odmítnutí celého Vydání výskytu výkazu, ale pouze odmítnutí konkrétních zaslaných záznamů změnové opravy.

|  |
| --- |
| Popis kontroly |
| Je-li záznam zaslán s parametrem T0023 = N, nesmí existovat platný záznam se stejným identifikačním klíčem. |
| Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = R, musí existovat platný záznam se stejným identifikačním klíčem. |
| Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = X, musí existovat platný záznam se stejným identifikačním klíčem. |

**Kontroly parametru T0024 ověřující přípustnost záznamu Transakce**

Tyto kontroly zajišťují vzájemnou přípustnou návaznost záznamů Transakcí se stejnou identifikací transakčními parametry.

Návaznost se kontroluje vzhledem k aktuálně platným datům i v rámci zaslaného Vydání výskytu výkazu.

Provádí se sekvenčně pro každý záznam Vydání výskytu výkazu (v pořadí podle T0019) v rozsahu podle typu konsolidace a v případě chyby není odmítnuto celé Vydání výskytu výkazu, ale jen příslušný zaslaný záznam.

|  |
| --- |
| Popis kontroly |
| Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = NEWT, nesmí existovat platný záznam se stejným transakčním klíčem. |
| Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = CANC, musí existovat platný záznam se stejným transakčním klíčem. |
| Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = (CANC nebo AMND), musí existovat platný záznam se stejným transakčním klíčem. |

Zda se Transakce kontrolují v rozsahu Výkazu jako celku nebo v rozsahu Výkazu za Osobu, bude dáno způsobem konsolidace dat daného Výkazu.

**Kontroly parametru T0025 ověřující přípustnost záznamu „Položky číselníku“**

Tyto kontroly zajišťují vzájemnou přípustnou návaznost záznamů „Položek číselníků“ se stejnou identifikací popisnými parametry.

Tato kontrola v případě chyby nezpůsobí odmítnutí celého Vydání výskytu výkazu, ale pouze odmítnutí konkrétních zaslaných záznamů.

|  |
| --- |
| Popis kontroly |
| Je-li záznam zaslán záznam s parametrem T0025=X, musí existovat platný záznam se stejným číselníkovým klíčem. |

## Závažnost JVK a MVK kontrol

Nepředpokládá se rozšíření stávajících stupňů závažnosti kontrol.

Pro číselníkové a transakční výkazy bude typ „Závažná“ znamenat:

* JVK – zamítnut bude záznam Transakce nebo „Položky číselníku“, nikoliv odmítnutí celého Vydání výskytu výkazu.
* MVK – nebudou akceptována data příslušných Transakcí z hlediska kvality MVK.

## Skupiny a pořadí kontrol

JVK kontroly v rámci Výkazu nebo MVK kontroly v rámci Skupiny MVK mohou být rozděleny do dílčích Skupin **kontrol**.

Skupina kontrol i Kontrola budou doplněny o nový nepovinný atribut **Pořadí zpracování,** který bude použit v případě, že bude potřeba určit pořadí provádění kontrol v rámci zpracování JVK Výkazu nebo MVK Skupiny MVK.

Skupina kontrol bude doplněna o nový atribut **Výsledek chyba.** Tento atribut bude umožňovat nastavení stavu Transakce na požadovanou hodnotu (RCVD, PDNG, RJCT). Pokud alespoň jedna kontrola Skupiny kontrol vrátí chybu, nastaví se stav Transakce na hodnotu definovanou v atributu Výsledek chyba, v opačném případě se výsledek nenastaví a pokračuje se ve zpracování dál. V případě, že všechny kontroly (u všech skupin) proběhnou úspěšně, výsledný stav transakce se nastaví na ACPT.

Zatím se předpokládá následující použití:

* JVK transakčního výkazu – kontroly mohou být rozděleny do Skupin kontrol s určením jejich pořadí, přičemž pro provedení kontrol Skupiny kontrol bude vyhodnocen stav zpracování dané Transakce a podle výsledku bude nebo nebude pokračovat další zpracování dané Transakce.
* MVK transakčních výkazů – kontroly budou seskupeny do Skupin kontrol podle Výkazů, které se kontrol účastní. Kontroly v jedné Skupině budou mít shodný Výkaz vlastnické DO a také shodné ostatní Výkazy, které se kontroly účastní.

## Podmíněnéspouštění JVK a MVK kontrol

U Skupiny kontrol (a případně i u Kontroly) může být stávající atribut **Předpoklad** využit k definování specifické podmínky na stav transakce, kterou musí záznam splňovat, aby byl předmětem kontroly.

## Opakované zpracování JVK a MVK kontrol

Skupina kontrol i Kontrola budou doplněny o nový nepovinný atribut **Opakovat,** který bude definovat, že se má Skupina kontrol nebo Kontrola provádět opakovaně.

Opakované zpracování kontrol bude používáno u kontrol, které používají externí datové zdroje (např. externí číselníky FIRDS).

## Skupiny MVK

Zatímco u statistických výkazů se kontrolují aktuálně platná data Výskytů výkazů v rámci jedné Vykazující osoby a Stavů ke dni podle definovaných relativních období jednotlivých Členů skupiny MVK, pro transakční a číselníkové výkazy platí následující principy:

**Transakční výkazy:**

* Kontrolují se aktuálně platné akceptované Transakce na základě výsledků jednovýkazových kontrol.
* Kontrolují se Transakce, které byly přijaté v definovaném období zpětně od aktuálního data. Hloubka tohoto období se nastavuje v definici Člena skupiny MVK.
* Z hlediska Osoby se kontrolují Transakce (podmínky lze nastavit v definici Člena skupiny MVK):
* vykázané danou Vykazující osobou,
* případně i Transakce týkající dané Vykazující osoby, které byly vykázané ve Výskytu výkazu jinou Vykazující osobou nebo byly vykázané v rámci jiného Výkazu

**Číselníkové výkazy:**

* Číselníkový výkaz není vlastníkem Skupiny MVK, může být použit jako Člen skupiny MVK transakčního nebo statistického výkazu.
* Do kontrol vstupují vždy aktuálně platná data tohoto Výkazu za danou Vykazující osobu.

Definice Skupin MVK se rozšiřují o následující vlastnosti.

**Výkazy ve Skupině MVK**

Podle typu výkazu vlastníka Skupiny MVK (statistický, transakční) je možné zařadit do Skupiny MVK další výkazy:

* Statistický – Členy skupiny MVK mohou být pouze statistické nebo číselníkové výkazy.
* Transakční – Členy skupiny MVK mohou být transakční, číselníkové nebo statistické výkazy.

**Definování období dat výkazu**

Podle typu výkazu Člena skupiny MVK (statistický, transakční, číselníkový) je použita forma definice období, tzn. Výskytů výkazů, pro které se zpracování MVK provádí:

* Statistický – definováno je relativní období vzhledem k Výskytu výkazu vlastníka.
* Transakční – definována je hloubka období v počtu dní do minulosti, tzn. kontrolují Transakce zaslané v definovaném období do minulosti. Detailněji je problematika práce s hloubkou období vysvětlena na konkrétním příkladu v kapitole 6.5.2.
* Číselníkový – období se nedefinuje, implicitně se pracuje s aktuálně platnými daty číselníkového výkazu.

**Definování dalších podmínek**

V definici Člena skupiny MVK transakčního výkazu lze specifikovat další podmínky pro rozsah dat, které se do zpracování dané Skupiny MVK zahrnují:

* bez ohledu na Vykazující osobu (nelze použít u Vlastníka skupiny),
* omezené filtrační podmínkou.

Do objektu Člen skupiny MVK bude doplněn nový atribut **Typ podmínky,** který umožní specifikovat způsob výběru záznamů zahrnutých do MVK.

* Defaultně bude mít hodnotu OSOBA (výběr záznamů na základě shodné Osoby u Výskytu jako je ve Výskytu výkazu vlastníka.
* Pokud bude nastavena hodnota VYBER\_TRANSAKCE, bude možné do dalšího nového atributu **Podmínka** zapsat podmínku, pomocí které lze záznamy účastnící se MVK vybrat (např. výběr transakcí podle LEI bez ohledu na vykazující Osobu).

Předpokládá se využití tohoto mechanismu zejména pro transakční výkazy TRAFIM00 (transakce zaslané ČNB jinými CAs) a TRAFIM10, kde bude použit pro výběr transakcí, jejichž Identifikační kód subjektu provádějícího obchod bude shodný s kódem LEI pro Vykazující osobu Výkazu, který je vlastníkem Skupiny MVK.

Detailněji je problematika vysvětlena na konkrétním příkladu v kapitole 6.5.2.

## Jazyk kontrol

JVK a MVK kontroly budou zapsány v sémantickém a uživatelském jazyku kontrol.

Zavedeny budou nové funkce, především:

* Funkce pro práci s externími číselníky
* Funkce pro práci s Transakcemi
* Případné funkce pro specifické algoritmy

# Metodiky MKT

## Úvod

Vzhledem k tomu, že za oblast výkazů MKT bude možné do systému SDAT zasílat opravy i historických dat od roku 2018, budou v SDAT upraveny i historické metodiky tak, aby popisy Výkazů odpovídaly novým pravidlům a bylo možné data Výkazů MKT od roku 2018 zpracovávat v SDAT.

Upraveny budou historické metodiky MKT20180103.1, MKT20190101.1. a MKT20201101.

## Knihovna

### Technické parametry

Knihovny potřebné pro metodiky MKT od roku 2018 obsahují technické parametry T0019, T0021, T0023, T0024, T0025 s příslušnými číselníky, doménami a datovými typy.

* Parametry T0019 a T0021 byly používány již ve výkazech v MtS.
* Parametr T0023 je v SDAT již používán pro výkazy JISIFE a výkazy Anacredit.
* Parametry T0024 a T0025 jsou nové.

### Transakční parametry

Knihovny potřebné pro metodiky MKT od roku 2018 obsahují transakční parametry.

* Parametry R0011, R0012, R0013, R0014, R0015, R0021 byly používány již ve výkazech v MtS.
* Parametry R0101, R0102, R0103, R0104, R0105, R0106, R0107, R0108, R0109, R0110, R0111, R0112 jsou nové a nahrazují Informační prvky, které byly používány ve výkazech v MtS.

## Výkazy

### Úvod

Ve výkazech metodik MKT jsou provedeny následující typové změny:

* Každý výkaz má definován Typ – statistický, transakční, číselníkový, který určuje základní charakteristiky zasílání a zpracování dat daného výkazu.
* Datové oblasti transakčních a číselníkových výkazů mají definováno, jaký typ dat daná datová oblast obsahuje – nové/opravené nebo zrušené transakce, doplňkové informace k transakcím, nové/opravené/stornované „záznamy číselníku“ , doplňkové informace k „záznamům číselníků“.
* Podle pravidel pro typy výkazů a datových oblastí jsou doplněny technické parametry a jejich konkretizace.
* V některých datových oblastech jsou změněny ukazatele na dynamické parametry a naopak, aby dané datové oblasti odpovídaly jednotným pravidlům pro daný typ.

V následující tabulce je přehled charakteristik výkazů MKT:

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Výkaz | Formát | Typ výkazu | Periodicita | Opravy | Technické parametry | Unikátní identifikace |
| TRAFIM10 | ISO (ESMA) | Transakční | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt (jen zrušení) | T0019 (T0021)T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM00 | ISO (ESMA) | Transakční | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt(jen zrušení) | T0019 (T0021)T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM11 | SDAT (ČNB) | Transakční | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt(jen zrušení) | T0019T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM12 | SDAT (ČNB) | Transakční | Denní | Bez vazby na Výskyt(jen zrušení) | T0019 (T0021)T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM20 | ISO (ESMA) | Transakční | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt(jen zrušení) | T0019 (T0021)T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM30 | SDAT (ČNB) | Transakční | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019 (T0021)T0024 | R0014, R0015  |
| TRAFIM40 | SDAT (ČNB) | Statistický | Denní | Úplná k výskytuZměnová k výskytu | (T0021)T0023 | R0018R0114R0016 |
| SETFIM50 | SDAT (ČNB) | Transakční | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019T0024 | R0021 |
| STAFIM60 | SDAT (ČNB) | Statistický | Denní | Úplná k výskytu | T0019 |  |
| STAFIM70 | SDAT (ČNB) | Statistický | Denní | Úplná k výskytu | T0019 |  |
| REFFIM10 | SDAT (ČNB) | Číselníkový | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019 (T0021)T0025 | R0101R0102R0103R0104 |
| REFFIM20 | SDAT (ČNB) | Číselníkový | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019 (T0021)T0025 | R0101R0102R0103R0104 |
| PERFIM30 | SDAT (ČNB) | Číselníkový | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019T0025 | R0109R0106R0107R0108 |
| PARFIM40 | SDAT (ČNB) | Číselníkový | Denníad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019T0025 | R0109R0106R0107 |
| KOMFIM10 | ISO(ESMA) | Transakční | Týdenní | Bez vazby na Výskyt | T0019T0024 | R0013, T0020, R0112 |
| KOMFIM20 | SDAT(ČNB) | Transakční | Denní | Úplná k výskytu | T0019T0024 | R0013R0113R0112 |
| KOMFIM30 | SDAT(ČNB) | Transakční | Denníad-hoc | Úplná k výskytu | T0019T0024 | R0013R0113R0112 |

### TRAFIM10

Výkaz obsahuje informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR (OCP) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0011 (Referenční číslo obchodu) a R0012 (Identifikační kód subjektu provádějícího obchod).
* Datová oblast TRAF10\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce. Doplněna je konstantní konkretizace parametru T0024 s hodnotou NEWT – nový.
* Datová oblast TRAF10\_51 má typ „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Doplněna je konstantní konkretizace parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* Ostatní datové oblasti mají typ „Transakční – detail“ a obsahují detailní informace k transakcím zaslaným v Datové oblasti TRAF10\_11.
* V datových oblastech jsou technické parametry T0019 a T0021 beze změny.

### TRAFIM20

Výkaz obsahuje informace o uzavřených, vypořádaných a zrušených obchodech a převodech (OCP) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0011 (Referenční číslo obchodu) a R0012 (Identifikační kód subjektu provádějícího obchod).
* Datová oblast TRAF20\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce. Doplněna je konstantní konkretizace parametru T0024 s hodnotou NEWT – nový.
* Datová oblast TRAF20\_51 má typ „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Doplněna je konstantní konkretizace parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* Ostatní datové oblasti mají typ „Transakční – detail“ a obsahují detailní informace k transakcím zaslaným v Datové oblasti TRAF20\_11.
* V datových oblastech jsou technické parametry T0019 a T0021 beze změny.

### TRAFIM00

Výkaz obsahuje informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR (OCP z ostatních zemí) a je typu „Transakční“.

Výkaz TRAFIM00 obsahuje transakce obdržené přes ESMA HUB z jiných CAs. Vykazující osobou zde tedy není osoba provádějící obchod, ale národní regulátor v zemi, kde sídlí centrála vykazující pobočky. Jako identifikátor osoby provádějící obchod je zde pro pobočky v souladu s legislativou použit LEI centrály.

Komunikaci s ESMA HUB zajišťuje interní systém ČNB (TREM-ČNB), který také data za jednotlivé národní regulátory „vykazuje“ do SDAT. Dále jsou tato data z pohledu SDAT zpracovávána obdobným způsobem jako TRAFIM10. Vzhledem k mechanismu vykazování by zde nemělo být možné vykázání stejných transakcí různými subjekty, a proto je možné konsolidaci provádět na úrovni Vykazující osoby.

Metapopis (podstatné informace):

* Výkaz TRAFIM00 bude standardně naprojektován v SDAT.
* Věcná struktura výkazu je obsahově shodná s výkazem TRAFIM10, obsahuje ale rozšiřující technické informace, pro které bude vytvořena další Datová oblast TRAF00\_12.
* Odlišnosti proti výkazu TRAFIM10 jsou také v kontrolách.

Transakce zaslané ve výkazu TRAFIM00 mohou v budoucnou podle identifikátoru osoby provádějící obchod R0012 vstupovat do mezivýkazových kontrol (viz kapitola 6.5.2)

### TRAFIM11

Výkaz obsahuje doplňkové informace o uzavřených, vypořádaných a zrušených obchodech a převodech (OCP), tedy k transakcím zaslaným ve výkazech TRAFIM10, TRAFIM20 nebo TRAFIM00. Výkaz je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0011 (Referenční číslo obchodu) a R0012 (Identifikační kód subjektu provádějícího obchod).
* Datová oblast TRAF11\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce. Doplněna je konstantní konkretizace parametru T0024 s hodnotou NEWT– nový.
* Doplněna je nová Datová oblast TRAF11\_51 typu „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Obsahuje konstantní konkretizaci parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* V datových oblastech je technický parametr T0019.

### TRAFIM30

Výkaz obsahuje informace o všech přijatých pokynech (OCP) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0014 (Identifikační kód pokynu) a R0015 (Identifikace subjektu, který pokyn přijal).
* Datová oblast TRAF30\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové a opravené transakce.
* Dosavadní dynamický popisný parametr P0570 (Status pokynu) je nahrazen dynamickým technickým parametrem T0024 s možnými hodnotami – NEWT – nový, AMND – oprava.
* Dosavadní dynamický parametr P0019 (Struktura sledovaných změn) je nahrazen ukazatelem FIM0436.
* Datová oblast TRAF30\_21 má typ „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Doplněna je konstantní konkretizace parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* Pro technické zrušení (např. omylem zaslané Transakce) je doplněn Datový typ R\_REASON pro důvod zrušení o novou hodnotu ‘T‘.
* Ostatní datové oblasti mají typ „Transakční – detail“ a obsahují detailní informace k transakcím zaslaným v Datové oblasti TRAF30\_11.
* V datových oblastech je technický parametr T0019 a T0021 beze změny.

### TRAFIM12

Výkaz obsahuje informace o obchodech s investičními nástroji pro obchodní systémy (ORT) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0011 (Referenční číslo obchodu) a R0012 (Identifikační kód subjektu provádějícího obchod).
* Datová oblast TRAF12\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce. Doplněna je konstantní konkretizace parametru T0024 s hodnotou NEWT – nový.
* Doplněna je nová Datová oblast TRAF12\_51 typu „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Obsahuje konstantní konkretizaci parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* Ostatní datové oblasti mají typ „Transakční – detail“ a obsahují detailní informace k transakcím zaslaným v Datové oblasti TRAF12\_11.
* Do všech datových oblastí je doplněn technický parametr T0019, technický parametr T0021 zůstává beze změny.

### SETFIM50

Výkaz obsahuje informace o vypořádání obchodů a převodů (Vypořádací systémy) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčním parametrem R0021 (Interní číslo transakce).
* Datová oblast SETF50\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce.
* Dosavadní dynamický popisný parametr P1570 (Status vypořádání) je nahrazen technickým parametrem T0024 s možnými hodnotami – NEWT – nový, AMND – oprava.
* Dosavadní dynamický parametr P0019 (Struktura sledovaných změn) je nahrazen ukazatelem FIM0436.
* Doplněna je nová Datová oblast SETF50\_51 typu „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Obsahuje konstantní konkretizaci parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* V datových oblastí je technický parametr T0019 beze změny.

### REFFIM10

Výkaz obsahuje informace o investičních nástrojích, kterých se týkaly pokyny, obchody a převody (OCP) a je typu „Číselníkový“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Dosavadní ukazatele jednoznačně identifikující „Položku číselníku“ v datových oblastech REFF10\_11 a REFF10\_21 jsou převedeny na popisné parametry.
* RDF0033 (Identifikace investičního nástroje – ISIN) → R0101
* RDF0034 (Identifikace investičního nástroje – All) → R0102
* RDF0035 (Identifikace investičního nástroje – ID) → R0103
* RDF0036 (Identifikace investičního nástroje – Ticker) → R0104
* Datová oblast REFF10\_11 má typ „Číselníková – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové, opravené nebo stornované „Položky číselníku“.
* Doplněn je nepovinný dynamický parametr T0025 s možnými hodnotami X – storno, který se použije v případě zaslání storna „Položky číselníku“.
* Pro nové nebo opravené „Položky číselníku“ se hodnota parametru T0025 nevyplňuje.
* Datová oblast REFF10\_21 má typ „Číselníková – detail“ a obsahuje doplňující informace k „Položkám číselníku“ zaslaným v REFF10\_11.
* V datových oblastech jsou technické parametry T0019 a T0021 beze změny.

### REFFIM20

Výkaz obsahuje informace o nástrojích přijatých k vypořádání (Vypořádací systémy) a je typu „Číselníkový“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Dosavadní ukazatele jednoznačně identifikující „Položku číselníku“ v datových oblastech REFF20\_11 a REFF20\_21 jsou převedeny na transakční parametry.
* RDF0033 (Identifikace investičního nástroje – ISIN) → R0101
* RDF0034 (Identifikace investičního nástroje – All) → R0102
* RDF0035 (Identifikace investičního nástroje – ID) → R0103
* RDF0036 (Identifikace investičního nástroje – Ticker) → R0104
* Datová oblast REFF20\_11 má typ „Číselníková – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové, opravené nebo stornované „Položky číselníku“.
* Doplněn je nepovinný dynamický parametr T0025 s možnými hodnotami X – storno, který se použije v případě zaslání storna „Položky číselníku“.
* Pro nové nebo opravené „Položky číselníku“ se hodnota parametru T0025 nevyplňuje.
* Datová oblast REFF20\_21 má typ „Číselníková – detail“ a obsahuje doplňující informace k „Položkám číselníku“ zaslaným v REFF20\_11.
* V datových oblastech jsou technické parametry T0019 a T0021 beze změny.

### PERFIM30

Výkaz obsahuje informace o osobách (OCP) a je typu „Číselníkový“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Dosavadní ukazatele jednoznačně identifikující „Položku číselníku“ v datové oblasti PERF30\_11 jsou převedeny na transakční parametry.
* RDF0002 (Identifikace právnické osoby – LEI kód) → R0109
* RDF0003 (Identifikace právnické osoby – IČ) → R0106
* RDF0005 (Identifikační kód fyzické osoby) → R0107
* RDF0134 (Typ osoby) → R0108
* Dosavadní dynamický parametr P0236 (Ekonomické sektory podle ESA2010) je nahrazen odpovídajícím ukazatelem RFD0137.
* Datová oblast PERF30\_11 má typ „Číselníková – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové, opravené nebo stornované „Položky číselníku“.
* Doplněn je nepovinný dynamický parametr T0025 s možnými hodnotami X – storno, který se použije v případě zaslání storna „Položky číselníku“.
* Pro nové nebo opravené „položky číselníku“ se hodnota parametru T0025 nevyplňuje.
* V datové oblasti PERF30\_11 je technický parametr T0019 beze změny.

### PARFIM40

Výkaz obsahuje informace o účastnících obchodního systému a vypořádacího systému s neodvolatelností vypořádání (Vypořádací systémy) a je typu „Číselníkový“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Dosavadní ukazatele jednoznačně identifikující „Položku číselníku“ v datové oblasti PARF40\_11 jsou převedeny na transakční parametry.
* RDF0015 (Identifikace účastníka právnické osoby – LEI kód) → R0109
* RDF0016 (Identifikace účastníka právnické osoby – IČ) → R0106
* RDF0017 (Identifikační kód účastníka – fyzické osoby) → R0107
* Datová oblast PARF40\_11 má typ „Číselníková – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové, opravené nebo stornované „Položky číselníku“.
* Doplněn je nepovinný dynamický parametr T0025 s možnými hodnotami X – storno, který se použije v případě zaslání storna „Položky číselníku“.
* Pro nové nebo opravené „Položky číselníku“ se hodnota parametru T0025 nevyplňuje.
* V datové oblasti PERF40\_11 jsou doplněny nové údaje Datum zahájení platnosti účastníka (ukazatel RFD0138) a Datum ukončení platnosti účastníka (ukazatel RFD0139), které budou využity v MVK.
* V datové oblasti PARF40\_11 je technický parametr T0019 beze změny.

### TRAFIM40

Výkaz obsahuje Informace o objednávkách v obchodním systému (ORT) a je typu „Statistický“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* V datových oblastech TRAF40\_11, TRAF40\_21, TRAF40\_22 a TRAF40\_31 je doplněn dynamický technický parametr T0023 (Status záznamu změnové opravy).
* Údaj FIM0117 (Kód MIC segmentu) bude nahrazen odpovídajícím parametrem R0114.

### KOMFIM10

Výkaz obsahuje hlášení souhrnných pozic v komoditních derivátech, povolenkách na emise a jejich derivátech (Organizátoři regulovaných trhů) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0013 (Identifikační kód obchodního systému) R0113 (Identifikační kód produktu v obchodním systému) a novým transakčním parametrem R0112 (Datum příslušné zasílanému týdennímu hlášení).
* Datová oblast KOMF10\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce.
* Doplněn je dynamický technický parametr T0024 s možnými hodnotami – NEWT – nový, AMND – oprava.
* Údaj KDE0003 (Datum příslušné zasílanému týdennímu hlášení) bude nahrazen odpovídajícím transakčním parametrem R0112.
* Parametr T0020 (Identifikační kód produktu v obchodním systému) bude nahrazen odpovídajícím transakčním parametrem R0113.
* Doplněna je nová Datová oblast KOMF10\_51 typu „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Obsahuje konstantní konkretizaci parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* V datové oblasti KOMF10\_11 je technický parametr T0019.

### KOMFIM20

Výkaz obsahuje hlášení pozic v komoditních derivátech, povolenkách na emise a jejich derivátech (Organizátoři regulovaných trhů) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0013 (Identifikační kód obchodního systému) R0113 (Identifikační kód produktu v obchodním systému) a novým transakčním parametrem R0112 (Datum příslušné zasílanému týdennímu hlášení).
* Datová oblast KOMF20\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce.
* Doplněn je dynamický technický parametr T0024 s možnými hodnotami – NEWT – nový, AMND – oprava.
* Údaj KDE0003 (Datum příslušné zasílanému týdennímu hlášení) bude nahrazen odpovídajícím transakčním parametrem R0112.
* Parametr T0020 (Identifikační kód produktu v obchodním systému) bude nahrazen odpovídajícím transakčním parametrem R0113.
* Doplněna je nová Datová oblast KOMF20\_51 typu „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Obsahuje konstantní konkretizaci parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* V datové oblasti KOMF20\_11 je technický parametr T0019.

### KOMFIM30

Výkaz obsahuje hlášení vlastních pozic a pozic zákazníků v komoditních derivátech, povolenkách na emise a jejich derivátech (OCP) a je typu „Transakční“.

Metapopis (změny a podstatné informace):

* Transakce je unikátně identifikována transakčními parametry R0013 (Identifikační kód obchodního systému) R0113 (Identifikační kód produktu v obchodním systému) a novým transakčním parametrem R0112 (Datum příslušné zasílanému týdennímu hlášení).
* Datová oblast KOMF30\_11 má typ „Transakční – hlavní“ a obsahuje záznamy pro nové transakce.
* Doplněn je dynamický technický parametr T0024 s možnými hodnotami – NEWT – nový, AMND – oprava.
* Údaj KDE0003 (Datum příslušné zasílanému týdennímu hlášení) bude nahrazen odpovídajícím transakčním parametrem R0112.
* Parametr T0020 (Identifikační kód produktu v obchodním systému) bude nahrazen odpovídajícím transakčním parametrem R0113.
* Doplněna je nová Datová oblast KOMF30\_51 typu „Transakční – zrušené transakce“ a obsahuje záznamy pro zrušené transakce. Obsahuje konstantní konkretizaci parametru T0024 s hodnotou CANC – zrušení.
* V datové oblasti KOMF30\_11 je technický parametr T0019.

### STAFIM60

Výkaz obsahuje informace o cenách a objemech obchodů (Organizátoři regulovaných trhů) a je typu „Statistický“.

Obsah a struktura jsou beze změny.

### STAFIM70

Výkaz obsahuje informace o indexech (Organizátoři regulovaných trhů – komodity) a je typu „Statistický“.

Obsah a struktura jsou beze změny.

## Jednovýkazové kontroly

U jednovýkazových kontrol výkazů MKT se nepředpokládají zásadní věcné změny kontrol proti současnému stavu.

Proti aktuálnímu stavu v MtS budou provedeny tyto změny:

* Kontroly budou zapsány v jazyce kontrol SDAT a podobně jako u jiných oblastí výkazů (např. JISIFE, AnaCredit) mohou být některé kontroly rozděleny do více dílčích kontrol apod.
* Kontroly technických parametrů budou odstraněny z JVK a budou prováděny v rámci formálních kontrol.
* Doplněny budou kontroly na externí číselníky.
* Kvazi kontroly MVK budou z JVK kontrol přesunuty do navržených Skupin MVK.

## Mezivýkazové kontroly

### Úvod

V této kapitole jsou popsány Skupiny MVK pro transakční a číselníkové výkazy MKT.

Skupiny MVK jsou navrženy podle následujících principů:

* Skupina MVK zahrnuje všechny související transakční a číselníkové výkazy.
* Pokud Skupina MVK zahrnuje více transakčních výkazů, je jeden z nich zvolen jako vlastník. Volba vlastníka vychází z obsahu sbíraných dat v rámci každé Skupiny MVK. Pro vlastní provedení kontrol mezi danými výkazy však není podstatná.
* Není-li uvedeno jinak, jsou do Skupiny MVK zahrnuty pouze Výskyty výkazů, vykázané za stejnou Osobu.
* V rámci Skupiny MVK budou Kontroly rozděleny do Skupiny kontrol podle Výkazů, mezi jejichž údaji se kontrola provádí.
* Pokud je v podmínce uvedena hloubka období (počet dnů zpětně pro které se data ke kontrole vybírají), vztahuje se vždy na data Výkazu, který je pro danou Kontrolu vlastnický. U dat z ostatních Výkazů se žádné omezení neaplikuje.

### Skupina OCP

Skupina pro OCP zahrnuje následující Výkazy.

|  |  |
| --- | --- |
| Výkaz | Podmínka |
| TRAFIM11 (vlastník) | Transakce z Výskytů (-30 dní) |
| TRAFIM10 | Transakce z Výskytů (-30 dní) bez ohledu na osobu, kde R0012 = LEI Vykazující osoby z TRAFIM11 |
| TRAFIM20 | Transakce z Výskytů (-30 dní) |
| TRAFIM00 | Transakce z výskytů (-30 dní) bez ohledu na osobu, kde R0012 = LEI Vykazující osoby z TRAFIM11 |
| TRAFIM30 | Transakce z Výskytů (-30 dní) |
| REFFIM10 | Vše |
| PERFIM30 | Vše |

Vlastníkem byl zvolen výkaz TRAFIM11, který obsahuje doplňkové údaje k Transakcím, které byly zaslány v některém z výkazů TRAFIM10, TRAFIM20, TRAFIM00, přičemž některé Transakce mohly být vykázány za danou Osobu i jinou vykazující Osobou (v rámci výkazu TRAFIM10 nebo TRAFIM00).

Členy skupiny MVK pro výkazy TRAFIM10 a TRAFIM00 mají definovánu podmínku pro výběr Transakcí, které budou kontrolovány v rámci Skupiny MVK za příslušného OCP.

* **Pro výkaz TRAFIM10 jsou zahrnuty i Transakce zaslané ve Výskytech výkazů jiných vykazujících Osob (**ARM nebo Obchodní systém). V transakčním parametru R0012 mají LEI daného OCP.
* Z výkazu TRAFIM00 jsou zahrnuty Transakce zaslané národními regulátory v zemi, kde sídlí centrála vykazující pobočky. V transakčním parametru R0012 mají LEI daného OCP nebo, v případě Transakcí poboček zahraničního OCP, LEI centrály.

Tyto Transakce budou kontrolovány proti národnímu výkazu TRAFIM11 a číselníkovým výkazům REFFIM10 a PERFIM30.

Z hlediska období budou kontrolovány Transakce zaslané ve Výskytech výkazů zpětně ode dne zpracování MVK podle definované hloubky období.

* Kontrola dat Transakcí do minulosti vychází z toho, že aktuálně platné údaje k určité Transakci nemusí být zaslané ve Výskytech výkazu za stejný Stav ke dni (zpravidla se jedná o důsledek provádění oprav).
* Použití definované hloubky období je nejlépe demonstrovat na následujících příkladech:
* Pokud se kontroluje existence klíče Transakce zaslané v TRAFIM11 proti TRAFIM10, kontrolují se Transakce zaslané v TRAFIM11 zpětně dle definované hloubky období. Pro výkaz TRAFIM10 definovaná hloubka neplatí, tzn akceptovaná Transakce v TRAFIM10 musí existovat bez ohledu na Výskyt výkazu, ve kterém byla vykázána.
* Pokud se naopak kontroluje existence klíče Transakce zaslané v TRAFIM10 proti TRAFIM11, kontrolují se Transakce zaslané v TRAFIM10 zpětně dle definované hloubky období. Pro výkaz TRAFIM11 definovaná hloubka neplatí, tzn akceptovaná Transakce v TRAFIM11 musí existovat bez ohledu na Výskyt výkazu, ve kterém byla vykázána.
* Uvedená hloubka období -30 dní je pouze příklad, skutečné nastavení bude definováno v metodice podle provozních zkušeností.

### Skupina Obchodní systémy

Skupina pro Obchodní systémy zahrnuje následující Výkazy.

|  |  |
| --- | --- |
| Výkaz | Podmínka |
| TRAFIM12 (vlastník) | Transakce z Výskytů (-30 dní) |
| TRAFIM40 | vše (bude ještě zváženo zavedení omezení) |
| TRAFIM10 | Vše |
| PARFIM40 | Vše |

Informace k MVK skupiny pro Obchodní systémy budou upřesněny později.

Uvedená hloubka období -30 dní je pouze příklad, skutečné nastavení bude definováno v metodice podle provozních zkušeností.

### Skupina Vypořádání obchodů

Skupina pro Vypořádání obchodů zahrnuje následující Výkazy.

|  |  |
| --- | --- |
| Výkaz | Podmínka |
| SETFIM50 (vlastník) | Transakce z Výskytu (-30 dní) |
| REFFIM20 | Vše |
| PARFIM40 | Vše |

Transakční výkaz SETFIM50 se kontroluje proti číselníkovým výkazům REFFIM20 a PARFIM40. Kontrola probíhá nad Výskyty výkazů jedné Osoby.

Uvedená hloubka období -30 dní je pouze příklad, skutečné nastavení bude definováno v metodice podle provozních zkušeností.

# Zasílání a zpracování výkazů MKT

## Úvod

## Evidence Osob v SDAT

Vykazující osoby jsou standardně evidovány v registru osob systému SDAT.

Pokud Osoba zasílá data výkazu ve formátu ISO 20022, musí mít v registru osob v SDAT evidován Identifikátor ISO 20022.

## Zasílání dat výkazů

Data výkazů MKT lze zasílat prostřednictvím webové služby nebo webové aplikace SDAT.

Výkazy TRAFIM10, TRAFIM20 a KOMFIM10 lze zasílat pouze ve formátu ISO 20022 dle specifikace (xsd) ESMA. Ostatní výkazy lze zasílat pouze ve formátu XML-SDAT. Problematiku formátů přehledně shrnuje tabulka v kapitole 6.3.1.

Vykázání dat ve formátu ISO 200022 znamená nutnost sestavit vlastními prostředky soubor v tomto formátu. Webová aplikace SDAT umožňuje pouze takový soubor, formou uploadu, odeslat do zpracování v ČNB. Webová aplikace SDAT však soubor ve formátu ISO20022 nesestavuje, tj. nelze jí použít pro pořizování (typování) dat výkazů, které musí být vykázány v tomto formátu.

Proti původnímu záměru nebude v SDAT používán kanál SFTP pro zasílání některých specifických výkazů.

Naopak bude implementována možnost zaslání **Děleného vydání.**

Pro statistické typy výkazů, které budou potenciálně překračovat povolenou velikost, bude možné Vydání rozdělit na více částí, kde každá část samostatně povolený limit nepřekročí.

* Jednotlivé části budou zasílány jako samostatná Vydání výskytů výkazů typu DATA\_CAST v samostatných Vstupních zprávách.
* Poslední část bude zaslána jako Vydání výskytu výkazu typu DATA.
* Jednotlivá Vydání (části) musí pro zajištění úplnosti a správného pořadí zpracování referencovat předchozí Vydání (část) pomocí atributu Referenční číslo vydání.

Pokud nebude některá část přijata z důvodu chyby v hlavičce, jsou odmítnuty všechny ostatní části.

Zpracování v SDAT bude zahájeno až po přijetí všech dílčích částí a bude probíhat standardně jako u neděleného Vydání.

* V případě formálních a formátových chyb jsou všechna zaslaná data odmítnuta a musí být zaslána znovu, tj. všechny části Děleného vydání.
* V případě závažných JVK chyb je celé Vydání výskytu výkazu odmítnuto a musí být zaslána úplná nebo změnová oprava (pokud je povolena). Pokud je pro daný výkaz povoleno zasílání změnových oprav s pomocí parametru T0023, je v případě potřeby možné poslat i Vydání výskytu výkazu se změnovými opravami jako dělené. V případě, že je povolena pouze úplná oprava, musí být zaslány všechny části Děleného vydání.

Pro číselníkové a transakční typy výkazů nebude vlastnost Dělení výkazů používána. Pro tyto výkazy bude možné zasílat více Vydání k jednomu Výskytu a všechna tato Vydání budou typu = DATA. Všechna Vydání (kromě prvního ke každému Výskytu) ale musí mít korektně vyplněnu referenci „Referenční číslo vydání“ na předchozí zaslané Vydání. V případě, že reference není správně vyplněna, je Vydání zamítnuto na formální chybu a není přijato ke zpracování. Jednotlivá vydání se zapracovávají nezávisle.

## Zpracování transakčních výkazů

### Výskyt transakčního výkazu

Výskyty transakčních výkazů budou vytvářeny podle definice vykazovacích povinností.

* Zpravidla budou mít nepravidelnou (ad-hoc) denní periodicitu (výkazy TRAFIM10, TRAFIM11, TRAFIM20, TRAFIM30, TRAFIM12, SETFIM50).
* Mohou mít i jinou nepravidelnou (ad-hoc) periodicitu (např. týdenní výkaz KOMFIM10).
* Mohou mít i pravidelnou periodicitu (pro aktuální výkazy zatím není použita).

Pro zasílání dat k Výskytu transakčního výkazu platí:

* V konkrétním kalendářním dnu jsou zasílána Vydání k Výskytu výkazu, kde Stav ke dni = kalendářní den.
* K jednomu Výskytu výkazu je možné zaslat více Vydání, u kterých je ale nutné vyznačit jejich vzájemnou návaznost (přes Referenční číslo Vydání).
* V určeném čase (podle definovaných pravidel) bude Výskyt výkazu uzavřen a nadále k němu nebude možné zasílat další Vydání.
* Uzavření Výskytu proběhne i v případě, kdy jsou k Výskytu evidovány chyby (zamítnuté nebo pending transakce).
* Existence Výskytu, který byl uzavřen s chybami nebude mít vliv na konsolidaci dat Výkazu, ta proběhne s vyloučením chybných dat.
* Opravy odmítnutých Transakcí nebo změny akceptovaných Transakcí budou zaslány v některém následujícím Výskytu, tzn. že proti statistickým výkazům nebudou opravy Transakcí zasílány k historickým Výskytům výkazů, v nichž byly původní záznamy Transakcí zaslány.

Pokud tedy vykazující Osoba nemá v daný den k transakčnímu výkazu žádné nové Transakce nebo žádné opravy Transakcí, nezasílá Vydání k Výskytu výkazu za daný Stav ke dni a Výskyt výkazu není ani založen.

Pokud má vykazující Osoba v daný den k transakčnímu výkazu nové Transakce nebo opravy dříve zaslaných Transakcí, zašle Vydání k Výskytu výkazu za daný Stav ke dni. Případné opravy chybných Transakcí nebo doplnění a změny Transakcí může zaslat v navazujícím Vydání k danému Výskytu výkazu, dokud není tento uzavřen. Po uzavření Výskytu výkazu k danému Stav ke dni zašle opravy v následujícím Výskytu výkazu.

### Stavový model zpracování Transakcí

Podstatou zpracování transakčních výkazů je získání správných dat jednotlivých Transakcí.

Stavový model pro zpracování Transakcí v principu odpovídá modelu definovaném ESMA, pro některé výkazy může být mírně modifikován (např. nemusí být používán stav “Pending“).

Stav se sleduje k Transakci jako celku, nikoliv k jednotlivým záznamům, které byly ke konkrétní Transakci zaslány. V systému se ukládá celá historie změn stavu Transakce.

Při zpracování Transakcí závisí výsledný stav na aktuálním stavu Transakce, na požadované akci a výsledku kontrol. Aktuální stav Transakce se zjišťuje v rámci celého Výkazu (včetně dosud zpracovaných Transakcí aktuálně zpracovávaného Vydání) bez ohledu na Vydání, ve kterém byla zaslána (v případě TRAFIM10 i bez ohledu na Osobu, která ji zaslala). Samotný výsledek kontrol může být buď bez chyb, s chybami nebo výsledek nelze aktuálně určit a Transakce je ve stavu “Pending“.



Ve Vydání výskytu výkazu může být zasláno více záznamů ke stejné Transakci.

* Ve Vydání výskytu výkazu ve formátu XML SDAT je pořadí zpracování Transakcí dáno technickým parametrem T0019.
* Ve Vydání výskytu výkazu ve formátu ISO 20022 je pořadí zpracování Transakcí dáno pořadím záznamu v XML souboru.

Při zpracování Vydání výskytu výkazu se jednotlivé Transakce zpracovávají sekvenčně podle parametru T0019 (formát XML SDAT) nebo pořadí záznamu v souboru (formát ISO 20022). Pokud výkaz obsahuje speciální Datovou oblast pro rušené transakce, je sekvence T0019 unikátní nad oběma Datovými oblastmi – pro nové i rušené Transakce.

Požadovaná akce k Transakci je definována ve formátu:

* XML SDAT – hodnotou technického parametru T0024
* ISO 20022 – rozlišením nových a zrušených Transakcí podle XSD

Pro jednotlivé zaslané akce k Transakci platí:

* Nová
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Akceptovaná, je nová Transakce zamítnuta a zůstává uložen původní platný záznam a aktuální stav Transakce se v SDAT nemění.
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Čekající (pending), je nová Transakce zamítnuta a zůstává uložen původní platný záznam a aktuální stav Transakce se v SDAT nemění (zůstává Čekající).
* Jestliže Transakce v SDAT dosud není nebo je platná Transakce se Stav transakce = Zrušená a JVK kontroly zjistí chyby, je nová Transakce zamítnuta.
* Jestliže Transakce v SDAT dosud není nebo je platná Transakce se Stav transakce = Zrušená a JVK kontroly nezjistí chyby, je nová Transakce akceptována (Stav transakce = Akceptovaná).
* Jestliže Transakce v SDAT dosud není nebo je platná Transakce se Stav transakce = Zrušená a JVK kontroly nezjistí chyby, ale některé z nich nelze dokončit, je Transakce uložena se Stav transakce = Čekající, po dokončení kontrol je následně buď akceptována nebo zamítnuta.
* Zrušení
* Jestliže Transakce v SDAT dosud není nebo je Stav transakce = Zrušená, je zaslané zrušení zamítnuto. Transakce zůstává dále zrušená.
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Akceptovaná nebo Čekající a na rušícím záznamu kontroly zjistí chyby (pokud je definována nějaká JVK kontrola rušícího záznamu), je zrušení zamítnuto. Zůstává uložen původní platný záznam a aktuální stav Transakce se nemění.
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Akceptovaná nebo Čekající a kontroly nezjistí chyby (pokud je definována nějaká JVK kontrola rušícího záznamu), je zrušení akceptováno a aktuální Stav transakce =Zrušená.
* Oprava (nepoužívá se ve výkazech ISO 20022)
* Jestliže transakce v SDAT ještě není nebo je platná Transakce se Stav transakce = Zrušená, je oprava Transakce zamítnuta.
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Akceptovaná a JVK kontroly zjistí chyby, je oprava transakce zamítnuta a aktuální stav Transakce se nemění.
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Akceptovaná a JVK kontroly nezjistí chyby, je oprava Transakce akceptována a stav Transakce se nemění.

Pokud jedno Vydání výskytu obsahuje více záznamů ke stejné Transakci, záznamy se zpracují sekvenčně (podle parametru T0019 nebo podle pořadí v souboru ISO 20022) podle výše uvedených pravidel.

Pokud je Transakce provedená v den T zároveň vykázaná v den T, tj. o den dříve, než je legislativní termín, je u ní nastaven Stav transakce = Přijatá (RCVD) a kontroly se provedou až v čase T+1. Podle jejich výsledku je pak tato Transakce přijata nebo zamítnuta. Pokud přijde v den T více záznamů na stejnou Transakci, zůstanou všechny ve stavu Přijatá a zpracují se v pořadí zaslání až v čase T+1 (včetně případného zrušení). Zatím se týká pouze výkazu TRAFIM10.

Záznamy v Datových oblastech obsahující rozšiřující informace navázané k Transakci v hlavní Datové oblasti přes technický parametr T0019 se samostatně neruší a neopravují, zpracovávají se vždy společně se záznamem v hlavní Datové oblasti

### Zpracování Vydání výskytu transakčního výkazu

Pro Vydání výskytu transakčního výkazu platí následující pravidla:

* Pokud je Vydání zasláno k uzavřenému Výskytu výkazu, je odmítnuto.
* Pokud data Vydání obsahují formální nebo formátové chyby, je odmítnuto jako celek.
* Pokud jsou zjištěny chyby v návaznosti zaslaných záznamů Transakcí, jsou tyto záznamy odmítnuty.
* Pokud jsou zjištěny chyby JVK, jsou odmítnuty příslušné záznamy Transakcí, není odmítnuto Vydání jako celek.
* Pokud nelze některé JVK kontroly v daném zpracování vyhodnotit a na daném záznamu Transakce nejsou zjištěny další JVK chyby, je tato Transakce ve stavu Čekající (pending).
* Tyto záznamy jsou opakovaně kontrolovány v rámci zpracování následujícího Vydání k danému Výkazu za danou Osobu.
* Pokud není určitý den zasláno žádné Vydání, proběhne opakované zpracování kontrol Transakcí ve stavu Čekající samostatně po aktualizaci externího datového zdroje.
* Pokud se nepodaří vyhodnotit tyto kontroly do dne podle nastavené lhůty (pro výkaz TRAFIM10 bude lhůta 7 dní), bude Transakce zamítnuta.

## Zpracování číselníkového výkazu

### Výskyt číselníkového výkazu

Výskyty číselníkových výkazů budou vytvářeny podle definice vykazovacích povinností.

* Zpravidla budou mít nepravidelnou (ad-hoc) denní periodicitu (výkazy REFFIM10, REFFIM20, PERFIM30, PARFIM40).
* Mohou mít i jinou nepravidelnou (ad-hoc) periodicitu (pro aktuální výkazy zatím není použita).
* Mohou mít i pravidelnou periodicitu (pro aktuální výkazy zatím není použita).

Pro zasílání dat k Výskytu číselníkového výkazu platí:

* V konkrétním kalendářním dnu jsou zasílána Vydání k Výskytu výkazu, kde Stav ke dni = kalendářní den.
* K jednomu Výskytu výkazu je možné zaslat více Vydání, u kterých je ale nutné vyznačit jejich vzájemnou návaznost (přes Referenční číslo Vydání).
* V určeném čase (podle definovaných pravidel) bude Výskyt výkazu uzavřen a nadále k němu nebude možné zasílat další Vydání.
* Uzavření Výskytu proběhne i v případě, kdy jsou k Výskytu evidovány chyby (zamítnuté „Položky číselníku“).
* Existence Výskytu, který byl uzavřen s chybami nebude mít vliv na konsolidaci dat Výkazu, ta proběhne s vyloučením chybných dat.
* Opravy odmítnutých „Položek číselníku“ nebo změny „Položek číselníku“ budou zaslány v některém následujícím Výskytu, tzn. že proti statistickým výkazům nebudou opravy „Položek číselníku“ zasílány k historickým Výskytům výkazů, v nichž byly původní záznamy „Položek číselníku“ zaslány.

Pokud tedy vykazující Osoba nemá v daný den k číselníkovému výkazu žádné nové „Položky číselníku“ nebo žádné změny „Položek číselníku“, nezasílá Vydání k Výskytu výkazu za daný Stav ke dni a Výskyt výkazu není ani založen.

Pokud má vykazující Osoba v daný den k číselníkovému výkazu nové „Položky číselníku“ nebo změny dříve zaslaných „Položek číselníku“, zašle Vydání k Výskytu výkazu za daný Stav ke dni. Případné opravy chybných „Položek číselníku“ je vhodné zaslat v navazujícím Vydání k danému Výskytu výkazu, dokud není tento uzavřen, protože aktuální stav dat číselníkového výkazu bude používán v MVK. Po uzavření Výskytu výkazu k danému Stav ke dni lze zaslat opravy v následujícím Výskytu výkazu.

### Konsolidace dat číselníkové výkazu

U číselníkového výkazu se zaslaná data SDAT konsolidují na úrovni Výkazu pro Osobu.

* Výkaz číselníkového typu obsahuje dynamické popisné parametry, které jednoznačné identifikují „Položku číselníku“.
* Pokud je ve Vydání zaslán záznam s klíčem, který v SDAT neexistuje, a jsou zjištěny JVK chyby, je zaslaný záznam odmítnut
* Pokud je ve Vydání zaslán záznam s klíčem, který v SDAT existuje, a jsou zjištěny JVK chyby, je zaslaný záznam odmítnut a v SDAT zůstává platný původní stav.
* Pokud je ve Vydání zaslán záznam s klíčem, který v SDAT neexistuje, a nejsou zjištěny JVK chyby, je zaslaný záznam akceptován a v SDAT evidována jako platný.
* Pokud je ve Vydání zaslán záznam s klíčem, který v SDAT existuje, a nejsou zjištěny JVK chyby, je zaslaný záznam akceptován. Pokud jsou všechny údaje (včetně navázaných údajů v dalších datových oblastech) shodné, nedochází k žádné změně.
* Pokud je v daném Výkazu možnost změny parametrů klíče nebo storno záznamu, je technický parametr T0025 konkretizován jako dynamický parametr Datové oblasti.
* Změna parametrů klíče je realizována zasláním záznamu s parametrem T0025 = Storno pro původní unikátní identifikaci a současným zasláním záznamu s novou unikátní identifikací,
* Údaje v dalších datových oblastech navázané k záznamu „Položky číselníku“ v hlavní Datové oblasti přes technický parametr T0019 se samostatně neruší a neopravují, jejich konsolidace probíhá vždy společně se záznamem v hlavní Datové oblasti.

### Zpracování Vydání výskytu číselníkového výkazu

Pro Vydání výskytu číselníkového výkazu platí následující pravidla:

* Pokud je Vydání zasláno k uzavřenému Výskytu výkazu, je odmítnuto.
* Pokud data Vydání obsahují formální nebo formátové chyby, je odmítnuto jako celek.
* Pokud jsou zjištěny chyby JVK, jsou odmítnuty příslušné záznamy „Položek číselníku“, není odmítnuto Vydání jako celek.

## Zpracování mezivýkazových kontrol

Pokud je vlastníkem Skupiny MVK transakční výkaz, vztahuje se zpracování Skupiny MVK k Výskytu výkazu vlastníka Skupiny MVK.

Vlastní zpracování MVK je spuštěno za následujících podmínek:

* Pokud byla zaslána Vydání výskytů výkazů za daný Stav ke dni ke všem výkazům ve Skupině MVK, dojde ke spuštění zpracování MVK.
* Pokud tato situace nenastala, bude na Skupině MVK definován atribut **Čas spuštění**, který definuje časový okamžik, kdy bude vyhodnoceno, zda na některém z výkazů dané Skupiny MVK došlo ke změně, při které mají být spuštěny MVK.
* MVK jsou spuštěny, pokud byla zaslána data alespoň k jednomu výkazu ve Skupině MVK.

Ošetřeny budou následující specifické situace:

* Pokud k Výskytu výkazu vlastníka (nebo jinému transakčnímu výkazu ve skupině) nepřišlo žádné nové Vydání výskytu výkazu, ale některá z transakcí z předchozích Výskytů výkazu byla převedena do stavu, kdy spadá do rozsahu transakcí zahrnutých do Skupiny MVK (např. Transakce přešla ze stavu Čekající do stavu Akceptovaná), musí být provedena kontrola těchto Transakcí.
* Došlo ke zpracování Vydání výskytu výkazu číselníkového nebo transakčního Výkazu, který není vlastníkem Skupiny MVK a pokud existují Výskyty transakčního výkazu vlastníka z období, které je definováno požadovanou hloubkou kontrol, musí být Ttransakce v definované hloubce zkontrolovány proti aktuálnímu stavu číselníkového nebo transakčního výkazu.
* U výkazu člena skupiny MVK, který není vlastníkem Skupiny MVK, jsou akceptovány Transakce vztahující se k Osobě provádějící obchod (dle R0012 Identifikační kód subjektu provádějícího obchod) která odpovídá Vykazující osobě u Výskytu výkazu vlastníka Skupiny MVK. Specificky je to třeba řešit v případech, kdy Osoba provádějící obchod je jiná, než je Vykazující osoba zasílající data. Tyto Transakce musí být také zahrnuty do zpracování MVK.

Aby nedocházelo ke zbytečnému spouštění kontrol nad velkými objemy dat v případech, kdy se od posledního spuštění MVK určitá data nezměnila, budou Kontroly rozděleny do Skupin kontrol podle Výkazů, jejichž data se kontrolují a v rámci zpracování MVK budou provedeny pouze ty Kontroly, u kterých došlo k nějaké změně dat Výkazu od posledního spuštění MVK.