

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: 2.2***

**Identifikace dokumentu**

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |
| Název dokumentu: | **SDAT – nová podoba metodiky vykazovacího rámce MKT** |
| Verze dokumentu: | **2.2** |
| 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) |
| 2022-11-29 | 2.0 | Kompletní aktualizace a doplnění dokumentu. |
| 2022-03-01 | 2.1 | Upřesnění a doplnění mezivýkazovýkových kontrol.  Upravené nebo doplněné kapitoly:   * 5.6.2 * 6.5.2 * 6.5.4 * 7.6 |
| 2022-03-25 | 2.2 | Nová kapitola 6.4.1 Kontroly LEI identifikátorů |
|  |  |  |
|  |  |  |

**Obsah**

[1. Úvod 4](#_Toc99452078)

[1.1. Účel a obsah dokumentu 4](#_Toc99452079)

[1.2. Pojmy a zkratky 4](#_Toc99452080)

[2. Typy výkazů 6](#_Toc99452081)

[2.1. Úvod 6](#_Toc99452082)

[2.2. Statistický výkaz 6](#_Toc99452083)

[2.3. Transakční výkaz 6](#_Toc99452084)

[2.4. Číselníkový výkaz 7](#_Toc99452085)

[3. Technické a transakční parametry 8](#_Toc99452086)

[3.1. Technické parametry 8](#_Toc99452087)

[3.2. Transakční parametry 9](#_Toc99452088)

[4. Typy datových oblastí 10](#_Toc99452089)

[4.1. Úvod 10](#_Toc99452090)

[4.2. Transakční – hlavní 10](#_Toc99452091)

[4.3. Transakční – zrušené transakce 10](#_Toc99452092)

[4.4. Transakční – doplňková 11](#_Toc99452093)

[4.5. Číselníková – hlavní 11](#_Toc99452094)

[4.6. Číselníková – doplňková 11](#_Toc99452095)

[5. Kontroly 12](#_Toc99452096)

[5.1. Úvod 12](#_Toc99452097)

[5.2. Formální a formátové kontroly Vydání výskytu výkazu 13](#_Toc99452098)

[5.3. Formální kontroly návaznosti záznamů 14](#_Toc99452099)

[5.4. Závažnost JVK a MVK kontrol 15](#_Toc99452100)

[5.5. Jednovýkazové kontroly 16](#_Toc99452101)

[5.6. Mezivýkazové kontroly 17](#_Toc99452102)

[5.7. Jazyk kontrol 19](#_Toc99452103)

[6. Metodiky MKT 20](#_Toc99452104)

[6.1. Úvod 20](#_Toc99452105)

[6.2. Knihovna 20](#_Toc99452106)

[6.3. Výkazy 21](#_Toc99452107)

[6.4. Jednovýkazové kontroly 29](#_Toc99452108)

[6.5. Mezivýkazové kontroly 30](#_Toc99452109)

[7. Zasílání a zpracování výkazů MKT 34](#_Toc99452110)

[7.1. Úvod 34](#_Toc99452111)

[7.2. Evidence Osob v SDAT 34](#_Toc99452112)

[7.3. Zasílání dat výkazů 34](#_Toc99452113)

[7.4. Zpracování transakčních výkazů 35](#_Toc99452114)

[7.5. Zpracování číselníkového výkazu 57](#_Toc99452115)

[7.6. Zpracování mezivýkazových kontrol 65](#_Toc99452116)

# 

# 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 jsou v systému SDAT zavedeny pro potřeby zpracování výkazů MKT a budou obecně použitelné.
* **Metodiky MKT** – popisuje úpravy Metodik 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 všechna data za Výskyt výkazu – výkaz , osoba, rozsah vykazování, stav 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 vykazovány průběžně, 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 výkazech 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 a stav ke dni. 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 k Výskytu výkazu 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, formální kontroly návaznosti záznamů transakcí a jednovýkazové kontroly. V případě výskytu formátových nebo formálních chyb je odmítnuto zaslané Vydání výskytu výkazu jako celek.

V rámci formálních kontrol návaznosti záznamů transakcí a 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 „Čekající“ („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. Jelikož specifickou vlastností transakčních výkazů je možnost zaslání transakcí týkající vykazující osoby v rámci výskytu jiné vykazující osoby nebo dokonce v rámci jiného výkazu, mohou být v mezivýkazových kontrolách 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 a akceptací 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 a stav ke dni. Naplánování výskytů výkazů a povinné zaslání dat číselníkového výkazu za daný den je 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, formální kontroly návaznosti záznamů „Položek číselníku“ a jednovýkazové kontroly. V případě výskytu formátových nebo formálních chyb je odmítnuto zaslané Vydání výskytu výkazu jako celek.

V rámci formálních kontrol návaznosti záznamů „Položek číselníku“ a 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 (tzn. že hodnota parametru je v těchto případech nevyplněna).

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 nebo „Položek číselníku“ v číselníkových výkazech mají v systému SDAT nastaven typ „Transakční“.

Konkrétní transakční parametry jsou uvedeny v kapitole 6.3 pro jednotlivé datové oblasti.

# Typy datových oblastí

## Úvod

V transakčních výkazech se vyskytují následující typy Datových oblastí:

* Hlavní – obsahuje záznamy nových, opravených transakcí
* Zrušené transakce – obsahuje zrušené transakce
* Doplňková – 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“
* Doplňková – 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 – doplňková

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 – doplňková

Tento typ Datové oblasti obsahuje doplňující údaje k „položkám číselníku“ zaslaným v Datové oblasti typu „hlavní“ a v číselníkovém 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

V této kapitole jsou popsány nové vlastnosti kontrol, zavedené v souvislosti s transakčními a číselníkovými výkazy.

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

* Transakční výkaz – pokud není odmítnuto celé Vydání výskytu výkazu z formálních nebo formátových důvodů, jsou dále kontrolovány 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.
* Formální a formátové kontroly Vydání výskytu výkazu – zahrnuje standardní formální a formátové kontroly (XML struktura, povinnost, obor hodnot apod.) jako u statistických výkazů. Dále jsou zavedeny nové formální kontroly (viz popis v kapitole 5.2.3). Pokud je Vydání výskytu výkazu zasláno ve formátu ISO 20022 zahrnuje také specifické kontroly pro tento formát (viz popis v kapitole 5.2.1 ) Výskyt chyby vede na odmítnutí celého Vydání výskytu výkazu.
* Formální kontroly návaznosti – nové formální kontroly návaznosti zasílání záznamů Transakce – nové, změny, zrušení (viz popis v kapitole 5.3.1). Výskyt chyby vede na odmítnutí konkrétního záznamu Transakce.
* Jednovýkazové kontroly – věcné kontroly pouze mezi údaji konkrétního záznamu Transakce. Výskyt chyby vede na odmítnutí konkrétního záznamu Transakce. Podrobnější popis je níže v kapitole 5.5.
* Mezivýkazové kontroly – věcné kontroly mezi údaji záznamů souvisejících Transakce více transakčních výkazů nebo mezi údaji záznamů Transakce transakčních výkazů a údaji „Položek číselníků“ číselníkových výkazů. Výskyt chyby je evidován pro konkrétní záznam Transakce transakčního záznamu. Odstranění nesouladu může být řešeno opravou daných Transakce v transakčních výkazech nebo i opravou „Položek číselníků“ v číselníkových výkazech. Podrobnější popis je níže v kapitole 5.6.
* Číselníkový výkaz – údaje číselníkového výkazu se používají v mezivýkazových kontrolách údajů transakčních výkazů. Cílem je proto dosažení úplnosti a správnosti těchto údajů. Pokud není odmítnuto celé Vydání výskytu výkazu, jsou dále kontrolovány 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.
* Formální a formátové kontroly Vydání výskytu výkazu – zahrnuje standardní formální a formátové kontroly (XML struktura, povinnost, obor hodnot apod.) jako u statistických výkazů. Dále jsou zavedeny nové formální kontroly (viz popis v kapitole 5.2.3). Výskyt chyby vede na odmítnutí celého Vydání výskytu výkazu.
* Formální kontroly návaznosti záznamů – nové formální kontroly návaznosti zasílání záznamů „Položek číselníku“ – nové, změny, zrušení (viz popis v kapitole 5.3.2). Výskyt chyby vede na odmítnutí konkrétního záznamu „Položky číselníku“.
* Jednovýkazové kontroly – věcné kontroly mezi pouze mezi údaji konkrétního záznamu „Položky číselníku“. Výskyt chyby ve de na odmítnutí konkrétního záznamu „Položky číselníku“. Podrobnější popis je níže v kapitole 5.5.
* Mezivýkazové kontroly – číselníkové výkazy jsou zatím používány v mezivýkazových kontrolách pouze jako tzv.“cizí výkazy“ v MVK transakčních výkazů. Podrobnější popis je níže v kapitole 5.6.

Dále jsou popsány jednotlivé nové vlastnosti kontrol.

## Formální a formátové kontroly Vydání výskytu výkazu

### Formální a formátové kontroly Vydání ve formátu ISO 20022

Pokud je Vydání výskytu výkazu zasláno ve formátu ISO 20022, jsou prováděny formální a formátové kontroly podle specifikace ESMA pro daný Výkaz a dále kontroly související s formátem ISO 20022 definované nad rámec kontrol ESMA .

V následující tabulce je uveden seznam kontrol této skupiny pro výkazy TRAFIM10, TRAFIM20 a TRAFIM00. Pokud není uveden kód ESMA, je kontrola definovaná nad rámec kontrol ESMA.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Kód SDAT | Kód ESMA | Popis kontroly |
| SDAT\_0006 | FIL-105 | Obecná XML chyba dat vydání výskytu výkazu ve formátu ISO 20022.  The file structure does not correspond to the XML schema: |
| SDAT\_1125 | FIL-102 | Zip archiv neobsahuje právě jeden soubor ISO 20022.  The file contains more than 1 XML file. |
| SDAT\_1126 | FIL-103 | Název souboru není shodný s názvem zip archivu.  The name of the XML file is not consistent with the name of its container ZIP file. |
| SDAT\_1127 | FIL-101 | Zaslaný soubor nelze rozbalit.  The file cannot be decompressed. |
| SDAT\_1129 | FIL-107 | Soubor s daným názvem byl již zaslán v některém předchozím vydání.  File <text> has already been submitted once |
| SDAT\_2049 | FIL-104 | ISO 20022 Message Identifier v BAH hlavičce nekoresponduej s XML schématem.  The ISO 20022 Message Identifier in the BAH must refer to the latest schema approved |
| SDAT\_2051 |  | Identifikátor příjemce v BAH hlavičce není 'CZ'.  The receiving MessagingEndpoint must be 'CZ'. |
| SDAT\_2052 |  | Identifikátor vykazujícího subjektu v BAH hlavičce není ISO 20022 identifikátor vykazujícího subjektu.  The sending MessagingEndpoint must be LEI of submitting entitiy. |

### Formální a formátové kontroly Vydání ve formátu XML SDAT

Pokud je Vydání výskytu výkazu zasláno ve formátu XML SDAT, jsou prováděny standardní formální a formátové kontroly jako v případě dosavadních statistických výkazů.

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

### Formální kontroly technických parametrů T0019 a T0021

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

Tyto kontroly zajišťují základní konzistenci vazeb záznamů Datových oblastí v rámci Vydání výskytu transakčního nebo číselníkového výkazu, která jsou zaslaná ve formátu XML SDAT.

Poznámka: Ve Vydání výskytu výkazu ve formátu ISO 20022 jsou tyto vazby zajištěny implicitně samotnou XML strukturou.

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

V následující tabulce je seznam formálních kontrol této skupiny.

|  |  |
| --- | --- |
| Kód | Popis kontroly |
| SDAT\_2053 | Hodnota parametru T0019 je unikátní v hlavní datové oblasti, případně v hlavní i rušící datové oblasti (pokud existuje) zároveň. |
| SDAT\_2054 | Kombinace hodnot parametrů T0019 a T0021 je v datové oblasti unikátní. |
| SDAT\_2055 | Pro hodnotu parametru T0019 v doplňkové datové oblasti musí existovat odpovídají hodnota parametru T0019 v hlavní datové oblasti. |
| SDAT\_2061 | Společné dynamické parametry v hlavní a detailní datové oblasti musí mít pro záznamy se stejným pořadím stejné hodnoty. |
| SDAT\_2062 | K rušícímu záznamu nesmí existovat detailní záznam. |

## Formální kontroly návaznosti záznamů

### Formální kontroly návaznosti záznamů v transakčním výkazu

**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.

 Tyto chyby nezpůsobí odmítnutí celého Vydání výskytu výkazu, ale pouze odmítnutí konkrétních chybných záznamů Transakcí.

V následující tabulce je seznam formálních kontrol této skupiny.

|  |  |
| --- | --- |
| Kód | Popis kontroly |
| SDAT\_2056 | Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = NEWT, nesmí existovat platný záznam se stejným transakčním klíčem. |
| SDAT\_2057 | Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = CANC, musí existovat platný záznam se stejným transakčním klíčem. |
| SDAT\_2058 | Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = (CANC nebo AMND), musí existovat platný záznam se stejným transakčním klíčem. |
| SDAT\_2064 | Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = AMND, musí existovat záznam se stejným transakčním klíčem. |
| SDAT\_2065 | Je-li záznam zaslán s parametrem T0024 = AMND, musí existovat platný záznam se stejným transakčním klíčem. |

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

Protože některé transakční výkazy jsou zasílány ve formátu ISO 20022 a v protokolech ISO 20022 je třeba uvádět kódy kontrol podle specifikace ESMA, jsou pro některé kontroly kódy SDAT transformovány na kódy ESMA.

V následující tabulce je uvedena transformace kódů kontrol pro výkazy TRAFIM10, TRAFIM20 a TRAFIM00.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Kód SDAT | Kód ESMA | Popis kontroly |
| SDAT\_2056 | CON-023 | If the report is a new transaction, the transaction reference number shall pertain to a single transaction per the executing entity, i.e. the same transaction reference number has not been used before or pertains to a transaction that has been cancelled (the last accepted report with this transaction reference number was a cancellation report)." |
| SDAT\_2057 | CON-024 | "If the report is a cancellation report, a transaction with the same transaction reference number should have been reported by the executing entity before." |
| SDAT\_2058 | CON-025 | "If the report is a cancellation report, this transaction should be an active transaction (there was no cancellation report following the last accepted new transaction report for this transaction reference number)." |

### Formální kontroly návaznosti záznamů v číselníkovém 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 chybných záznamů „Položek číselníku“.

V následující tabulce je seznam formálních kontrol této skupiny.

|  |  |
| --- | --- |
| Kód | Popis kontroly |
| SDAT\_2059 | Je-li záznam zaslán záznam s parametrem T0025=X, musí existovat platný záznam se stejným číselníkovým klíčem. |

## Závažnost JVK a MVK kontrol

V procesech zpracování transakčních a číselníkových výkazů neexistuje (na rozdíl o statistických výkazů) potvrzování, takže v transakčních a číselníkových výkazech se nepoužívá závažnost „Potvrzení“.

V transakčních a číselníkových výkazech mohou mít JVK a MVK kontroly pouze typ:

* Závažná – kontrola má závažný charakter a zjištěný nesoulad v  datech musí být odstraněn. Zjištěné chyby se vždy vztahují ke konkrétní „Transakci“ transakčního výkazu nebo „Položce číselníku“ číselníkového výkazu a mají dopad akceptování konkrétních vykázaných Transakce transakčního výkazu nebo „Položek číselníku“ číselníkového výkazu.
* Varování – kontrola má pouze informativní charakter a nemá dopad na akceptování zaslaných dat.

## Jednovýkazové kontroly

### Úvod

V této kapitole jsou uvedeny specifické vlastnosti JVK, které jsou zavedeny do systému SDAT v souvislosti se zpracováním výkazů MKT.

Tyto vlastnosti vycházejí především z potřeb výkazu TRAFIM10, který je navržen dle specifikace ESMA.

* Specifické zpracování JVK – dosavadní obecný mechanismus vyhodnocování JVK je založen na vzájemné nezávislosti jednotlivých JVK kontrol. V některých výkazech (aktuálně TRAFIM10, TRAFIM20 a TRAFIM00) není tento princip dostačující a je v nich implementován specifický algoritmus provádění jednotlivých kontrol.
* Vyhodnocení JVK – se zavedením transakčních a číselníkových výkazů, kde se samostatně vyhodnocují JVK pro jednotlivé záznamy, jsou zavedena pravidla vycházející ze specifikací ESMA, ale jsou aplikována i pro ostatní výkazy těchto typů.
* Opakované zpracování JVK – opakované zpracování JVKL se obecně používá v případech, kdy se v kontrolách používají externí datové zdroje, jejichž proces aktualizace má dopad na vyhodnocení JVK. V oblasti MKT se jedná o externí číselníky FIRDS, přičemž na opakování JVK má vliv pouze externí číselník FIN\_INSTRUMENT.

### Specifické zpracování JVK

Ve výkazech TRAFIM10 a TRAFIM20 je zpracování JVK řízeno specifickým algoritmem, který vychází z charakteru dat a JVK daného výkazu. Tento algoritmus je specifikován v dokumentu ESMA

esma65-8-2356\_mifir\_transaction\_reporting\_technical\_reporting\_instructions.pdf).

Algoritmus má následující charakteristiky:

* Kontroly jsou rozděleny do osmi skupin Set 1 a až Set 8 podle věcné souvislosti a potřeb algoritmu provádění kontrol.
* Skupina obsahuje množinu kontrol, které mohou být provedeny společně.
* Skupina kontrola obsahuje množinu kontrol, které se provádějí pro všechny transakce nebo pouze pro věcně vymezenou množinu transakcí.
* Po provedení kontrol určité skupiny kontrol může být provedeno vyhodnocení výsledků kontrol a některé kontroly mohou ukončit zpracování transakcích, u kterých se tyto chyby vyskytly.

Systém SDAT poskytuje v metodice ČNB dílčí informace (nejedná se však o informace, na základě, kterých lze daný algoritmus plnohodnotně implementovat):

* Kontrola může obsahovat vazbu na skupinu kontrol.
* Ve webové aplikaci lze kontroly zobrazovat po skupinách.
* Ve webové službě obsahuje kontrola kód skupiny kontrol.
* Kontrola obsahuje atribut **Výsledek chyba** obsahující hodnotu stavu transakce (RJCT, PDNG), který se používá při vyhodnocení výsledného stavu transakce podle zjištěných chyb.

### Vyhodnocení JVK

Výsledek zpracování JVK se vyhodnocuje samostatně pro každý záznam Transakce.

V následující tabulce jsou pravidla nastavení stavu Transakce podle výsledku JVK.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Stav transakce | Status ISO | Vyhodnocení |
| Akceptováno | ACPT | Nevyskytla se žádná chyba JVK se závažností „Závažná“ |
| Odmítnuto | RJCT | Vyskytla se alespoň 1 chyba JVK se závažností „Závažná“ a výsledek chyba „RJCT“ |
| Čekající | PDNG | Nevyskytla se žádná chyba JVK se závažností „Závažná“ a výsledek chyba „RJCT“ a vyskytla se se alespoň 1 chyba JVK se závažností „Závažná“ a výsledek chyba „PDNG“ |

### Opakované zpracování JVK

Opakované zpracování JVK se v oblasti MKT aktuálně týká pouze výkazu TRAFIM10.

Opakované zpracování JVK se provádí pro Vydání výskytů výkazů, na kterých existující platné záznamy Transakcí ve stavu „Čekající“ (pending).

V rámci opakované zpracování JVK se provádí pro dané „Čekající“ transakce pouze kontroly JVK, které mají nastaven atribut Opakovat = „FIRDS“.

Výsledek JVK se vyhodnotí standardně.

## Mezivýkazové kontroly

### Úvod

V této kapitole jsou uvedeny nové vlastnosti MVK, které jsou zavedeny do systému SDAT v souvislosti se zpracováním transakčních a číselníkových výkazů MKT.

Cílem MVK je zajištění požadované konzistence dat:

* údajů souvisejících Transakcí zasílaných v různých výkazech,
* údajů souvisejících záznamů transakčních a číselníkových výkazů.

MVK transakčních a číselníkových mají následující specifika:

* Rozsah dat výkazu ve Skupině MVK – proti statistickým výkazům se odlišně vymezuje období dat vstupujících do MVK a kontroly mohou být prováděny ve specifických případech i mezi dat různých vykazujících osob (v tomto případě se jedná o specifikou vlastnost výkazů TRAFIM10 a TRAFIM00).
* Vyhodnocení MVK – u transakčních výkazů se samostatně vyhodnocují MVK pro jednotlivé záznamy daného transakčního výkazu.

### 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 a čekající Transakce na základě výsledků jednovýkazových kontrol.
* Kontrolují se Transakce, které byly přijaté od posledního zpracování Skupiny MVK nebo 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 **Pravidlo,** který umožní specifikovat způsob výběru záznamů zahrnutých do MVK.

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.

### Vyhodnocení MVK

Výsledek zpracování MVK se vyhodnocuje samostatně pro každý záznam Transakce.

V následující tabulce jsou pravidla nastavení stavu Transakce podle výsledku MVK.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Stav transakce | Status ISO | Vyhodnocení |
| Akceptováno | ACPT | Nevyskytla se žádná chyba MVK se závažností „Závažná“ |
| Odmítnuto | RJCT | Vyskytla se alespoň 1 chyba MVK se závažností „Závažná“ a výsledek chyba „RJCT“ |

### Opakované zpracování MVK

Ve výkazech MKT zatím nejsou žádné opakované MVK kontroly.

## Jazyk kontrol

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

Pro potřeby těchto kontrol je provedeno rozšíření jazyka:

* Upřesněny a rozšířeny jsou funkce pro práci s externími číselníky
* Doplněny jsou nové datumové funkce
* Doplněn je popis používání „absolutního období“ v mezivýkazových kontrolách

Detailně jsou nové i stávající funkce popsány v dokumentu „TS-8 Popis jazyka kontrol“.

# Metodiky MKT

## Úvod

Vzhledem k tomu, že za oblast výkazů MKT bude možné do systému SDAT zasílat opravy i historických dat od roku 2018, jsou v SDAT upraveny i historické metodiky tak, aby popisy Výkazů odpovídaly novým pravidlům a historická data bylo možné naplnit do systému SDAT ze systému MtS/MKT..Jedná se o historické metodiky MKT20180103.1, MKT20190101.1. a MKT20201101.1

Úpravy těchto metodik se netýkají obsahu jednotlivých výkazů, ale pouze metadat popisujících požadované údaje.

V roce 2022 bude vytvořena nová metodika MKT20220530, ve které budou drobné změny proti předchozí metodice MKT20201101 a bude platná od 30.5.2022.

V následující tabulce je přehled metodik MKT a jejich používání na testovacím (TEST) a produkčním (PROD) prostředí.

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Metodika | Platnost od | Platnost do | Použití na TEST | Použití na PROD |
| MKT20180103.1 | 3.1.2018 | 31.12.2018 | Testování statistických výkazů | Pouze opravy statistických výkazů |
| MKT20190101.1 | 1.1.2019 | 31.10.2020 | Testování statistických výkazů | Pouze opravy statistických výkazů |
| MKT20201101 | 1.11.2020 | 29.5.2022 | Testování statistických výkazů  Testování transakčních výkazů – výskyty od 1.12.2021  Testování číselníkových výkazů – výskyty od 1.12.2021 | Pouze opravy statistických výkazů |
| MKT20220530 | 30.5.2022 | 1.1.4000 | Testování v roce 2022 – bude upřesněno | Ostré vykazování od 30.5.2022 |

## 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 20022  (ESMA) | Transakční | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt (jen zrušení) | T0019 (T0021)  T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM00 | ISO 20022  (ESMA) | Transakční | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt  (jen zrušení) | T0019 (T0021)  T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM11 | XMLSDAT (ČNB) | Transakční | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt  (jen zrušení) | T0019  T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM12 | XMLSDAT (ČNB) | Transakční | Denní | Bez vazby na Výskyt  (jen zrušení) | T0019 (T0021)  T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM20 | ISO 20022  (ESMA) | Transakční | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt  (jen zrušení) | T0019 (T0021)  T0024 | R0011, R0012 |
| TRAFIM30 | XML SDAT (ČNB) | Transakční | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019 (T0021)  T0024 | R0014, R0015 |
| TRAFIM40 | XML SDAT (ČNB) | Statistický | Denní | Úplná k výskytu  Změnová k výskytu | (T0021)  T0023 | R0018  R0114  R0016 |
| SETFIM50 | XML SDAT (ČNB) | Transakční | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019  T0024 | R0021 |
| STAFIM60 | XMLSDAT (ČNB) | Statistický | Denní | Úplná k výskytu | T0019 |  |
| STAFIM70 | XMLSDAT (ČNB) | Statistický | Denní | Úplná k výskytu | T0019 |  |
| REFFIM10 | XMLSDAT (ČNB) | Číselníkový | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019 (T0021)  T0025 | R0101  R0102  R0103  R0104 |
| REFFIM20 | XMLSDAT (ČNB) | Číselníkový | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019 (T0021)  T0025 | R0101  R0102  R0103  R0104 |
| PERFIM30 | XMLSDAT (ČNB) | Číselníkový | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019  T0025 | R0109  R0106  R0107  R0108 |
| PARFIM40 | XMLSDAT (ČNB) | Číselníkový | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019  T0025 | R0109  R0106  R0107 |
| KOMFIM10 | ISO 20022  (ESMA) | Transakční | Týdenní | Bez vazby na Výskyt | T0019  T0024 | R0013, T0020,  R0112 |
| KOMFIM20 | XML SDAT  (ČNB) | Transakční | Denní | Bez vazby na Výskyt | T0019  T0024 | R0013  R0113  R0112 |
| KOMFIM30 | XML SDAT  (ČNB) | Transakční | Denní  ad-hoc | Bez vazby na Výskyt | T0019  T0024 | R0013  R0113  R0112 |

### 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 – doplňková“ a obsahují doplňující údaje 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 – doplňková“ a obsahují doplňující údaje 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 je 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\_61.
* Drobné odlišnosti proti výkazu TRAFIM10 jsou také v kontrolách.

Transakce zaslané ve výkazu TRAFIM00 mohou v budoucnu 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 – doplňková a obsahují doplňující údaje 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 – doplňková“ a obsahují doplňující údaje 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.
* RFD0033 (Identifikace investičního nástroje – ISIN) → R0101
* RFD0034 (Identifikace investičního nástroje – All) → R0102
* RFD0035 (Identifikace investičního nástroje – ID) → R0103
* RFD0036 (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 – doplňková“ a obsahuje doplňující údaje 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.
* RFD0033 (Identifikace investičního nástroje – ISIN) → R0101
* RFD0034 (Identifikace investičního nástroje – All) → R0102
* RFD0035 (Identifikace investičního nástroje – ID) → R0103
* RFD0036 (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 – doplňková“ a obsahuje doplňující údaje 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.
* RFD0002 (Identifikace právnické osoby – LEI kód) → R0109
* RFD0003 (Identifikace právnické osoby – IČ) → R0106
* RFD0005 (Identifikační kód fyzické osoby) → R0107
* RFD0134 (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.
* RFD0015 (Identifikace účastníka právnické osoby – LEI kód) → R0109
* RFD0016 (Identifikace účastníka právnické osoby – IČ) → R0106
* RFD0017 (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 nejsou zásadní věcné změny kontrol proti současnému stavu.

Proti aktuálnímu stavu v MtS budou provedeny tyto změny:

* Kontroly jsou zapsány v jazyce kontrol SDAT a podobně jako u jiných oblastí výkazů (např. JISIFE, AnaCredit) jsou některé kontroly rozděleny do více dílčích kontrol.
* Kontroly technických parametrů jsou odstraněny z JVK a jsou prováděny v rámci formálních kontrol.
* Kvazi kontroly MVK jsou z JVK kontrol přesunuty do navržených Skupin MVK.
* Pro výkazy zasílané ve formátu ISO 20022 jsou použity kódy dle specifikace ESMA.
* Používána je pouze závažnost „Závažná“ nebo „Varování“. Není používána závažnost „Potvrzení“.
* Kontroly LEI identifikátotrů

### Kontroly LEI identifikátorů

Jsou doplněny kontroly LEI identifikátorů. Pro tyto kontroly byla implementována nová funkce jazyka kontrol REF\_LEI\_ALLOWED().

* V případě, že vykazující osoba nemá roli ARM, nebo TS (obchodní systém) je kontrolováno, že vykázané LEI je shodné s LEI vykazující osoby v Registru osob.
* V případě, že vykazující osoba má roli ARM, nebo TS (obchodní systém) je kontrolováno, že vykázané LEI je LEI jedné z osob ve vztahu k ARM/TS.

Pro TRAFIM10 jsou vytvořeny 4 kontroly:

* CZX\_003 – Kontrola, zda vykazující osoba zasílá pouze transakce s vlastním LEI v TRAF10\_11.
* CZX\_005 - Kontrola, zda vykazující osoba zasílá pouze rušící transakce s vlastním LEI v TRAF10\_51.
* CZX\_004 - Kontrola, zda ARM/TS zasílá pouze transakce s LEI jedné z osob ve vztahu k ARM/TS v TRAF10\_11.
* CZX\_006 - Kontrola, zda ARM/TS zasílá pouze rušící transakce s LEI jedné z osob ve vztahu k ARM/TS v TRAF10\_11.

Dvě sady kontrol pro TRAFIM10 jsou vytvořeny pouze z důvodu odlišného kódu a hlášení pro vykazující subjekty a ARM/TS.

Pro TRAFIM10 je upraveno nastavení Vykazovací povinnosti:

* Pro vykazující osoby nastaveno CZX\_004 a CZX\_006 na NEPROVÁDĚT.
* Pro subjekty ARM/TS nastavit CZX\_003 a CZX\_005 na NEPROVÁDĚT.

Pro TRAFIM11, TRAFIM20 a TRAFIM30 jsou vytvořeny pouze kontroly CZX\_003 a CZX\_005 a bez úpravy VP.

## 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 – TRAF11\_01

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.

Členem skupiny MVK je také výkaz TRAFIM30 obsahují Transakce pokynů. Tyto Transakce jsou kontrolovány proti číselníkovým výkazů REFFIM10 a PERFIM30 a také proti Transakcím obchodů ve výkazu TRAFIM11, TRAFIM10 a TRAFIM20.

Kontroly TRAF11\_01 jsou nyní rozděleny do následujících Setů podle množiny Výkazů, mezi nimiž jsou příšlušné Kontroly prováděny.

|  |  |
| --- | --- |
| Skupina kontrol | Výkazy |
| Set1 | TRAFIM10, REFFIM10 |
| Set2 | TRAFIM10, PERFIM30 |
| Set3 | TRAFIM20, REFFIM10 |
| Set4 | TRAFIM20, PERFIM30 |
| Set5 | TRAFIM30, PERFIM30 |
| Set6 | TRAFIM30, REFFIM10 |
| Set7 | TRAFIM11, TRAFIM10, REFFIM10 |
| Set8 | TRAFIM11, TRAFIM20, PERFIM30 |
| Set9 | TRAFIM11, TRAFIM30 |
| Set10 | TRAFIM11, TRAFIM10, TRAFIM30 |
| Set11 | TRAFIM11, TRAFIM10, TRAFIM20, TRAFIM30 |

Z hlediska období mohou být kontrolovány Transakce zaslané ve Vydáních výskytů výkazů

* od posledního zpracování Skupiny MVK pro danou Osobu
* nebo zpětně ode dne zpracování MVK podle definované hloubky období (uvedená hloubka období -30 dní je pouze příklad, skutečné nastavení bude definováno v metodice podle provozních zkušeností).

Do zpracování Skupiny MVK jsou zahrnuté i Transakce, které byly v předchozím Běhu skupiny MVK zjištěny jako chybné bez ohledu na to, zda od posledního Běhu skupiny MVK k nim byl zaslán nějaký záznam.

Použití období je nejlépe demonstrovat na následujících příkladech:

* Pokud se kontroluje existence klíče Transakce zaslané v TRAFIM11 proti TRAFIM10, kontrolují se Transakce zaslané v TRAFIM11 od posledního Běhu skupiny MVK nebo zpětně dle definované hloubky období. Pro výkaz TRAFIM10 vymezení neplatí, tzn akceptovaná/čekající 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 od posledního Běhu skupiny MVK nebo zpětně dle definované hloubky období. Pro výkaz TRAFIM11 vymezení neplatí, tzn akceptovaná Transakce v TRAFIM11 musí existovat bez ohledu na Výskyt výkazu, ve kterém byla vykázána.

### Skupina Obchodní systémy – TRAF12\_01

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.

Kontroly TRAF12\_01 jsou rozděleny do následujících Setů podle množiny Výkazů, mezi nimiž jsou příšlušné Kontroly prováděny.

|  |  |
| --- | --- |
| Skupina kontrol | Výkazy |
| Set1 | TRAFIM12, TRAFIM10 |
| Set2 | TRAFIM12, TRAFIM40 |

### Skupina Vypořádání obchodů – SETF50\_01

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.

Kontroly SETF50\_01 jsou rozděleny do následujících Setů podle množiny Výkazů, mezi nimiž jsou příšlušné Kontroly prováděny.

|  |  |
| --- | --- |
| Skupina kontrol | Výkazy |
| Set1 | SETFIM50, REFFIM20 |
| Set2 | SETFIM50, PARFIM40 |

Z hlediska období mohou být kontrolovány Transakce zaslané ve Vydáních výskytů výkazů

* od posledního zpracování Skupiny MVK pro danou Osobu
* nebo zpětně ode dne zpracování MVK podle definované hloubky období (uvedená hloubka období -30 dní je pouze příklad, skutečné nastavení bude definováno v metodice podle provozních zkušeností).

Do zpracování Skupiny MVK jsou zahrnuté i Transakce, které byly v předchozím Běhu skupiny MVK zjištěny jako chybné bez ohledu na to, zda od posledního Běhu skupiny MVK k nim byl zaslán nějaký záznam.

# 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 není 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 jsou vytvářeny podle definice vykazovacích povinností.

* Zpravidla mají 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 termínu je Výskyt výkazu uzavřen a nadále k němu nelze zasílat další Vydání.
* Výskyt výkazu obsahuje nový nepovinný atribut Termín uzavření, který obsahuje datum a řas uzavření Výskytu výkazu, pokud má být uzavřen.
* Uzavření Výskytu proběhne i v případě, kdy jsou k Výskytu evidovány chyby (odmítnuté nebo čekající Transakce).
* Existence Výskytu, který byl uzavřen s chybami nemá vliv na konsolidaci dat Výkazu, ta probíhá průběžně v rámci zpracování každého Vydání výskytu výkazu s vyloučením chybných dat.
* Opravy odmítnutých Transakcí nebo změny (opravy nebo zrušení) akceptovaných Transakcí se zasílají v některém následujícím Výskytu, tzn. že proti statistickým výkazům nejsou 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 (formální chyba SDAT:2056) 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 (formální chyba SDAT\_2056) 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, jejichž výsledek způsobuje zamítnutí Transakce, je nová Transakce zamítnuta (chyby JVK).
* Jestliže Transakce v SDAT dosud není nebo je platná Transakce se Stav transakce = „Zrušená“ a JVK kontroly nezjistí žádné závažné 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 zjistí pouze chyby , jejichž výsledek způsobuje nastavení Transakce jako čekající, je Transakce uložena se Stav transakce = „Čekající“., V dalších procesech jsou kontroly JVK opakovány a daná Transakce je následně buď akceptována nebo zamítnuta (chyby JVK).
* Zrušení
* Jestliže Transakce v SDAT dosud není nebo je Stav transakce = „Zrušená“, je zaslané zrušení zamítnuto (formální chyby SDAT\_2057 resp. SDAT\_2058).
* 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 (chyba JVK). 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 (formální chyba SDAT\_2064 resp. SDAT\_2065).
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Akceptovaná a JVK kontroly zjistí chyby, je oprava transakce zamítnuta (chyby JVK) a aktuální stav Transakce se nemění.
* Jestliže v SDAT je platná Transakce se Stav transakce = Akceptovaná a JVK kontroly nezjistí závažné 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.

Výsledek zpracování JVK záznamu Transakce může ovlivnit i výsledek zpracování následujícího záznamu k dané Transakci.

Nastat mohou následující situace:

* Pokud je záznam nové Transakce zamítnut z důvod chyb JVK a ve Vydání výskytu výkazu je k dané Transakci zaslán navazující rušící záznam, je tento rušící záznam také zamítnut na formální chybu SDAT\_2057 resp. SDAT\_2058.
* Pokud je záznam zrušení Transakce zamítnut z důvod chyb JVK a ve Vydání výskytu výkazu je k dané Transakci zaslán navazující záznam nové Transakce, je tento záznam také zamítnut na formální chybu SDAT\_2056.

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

Zpracování Vydání výskytu transakčního výkazu se může členit do následujících dílčích částí:

* Zpracování Vydání výskytu výkazu – standardní zpracování Vydání výskytu výkazu.
* Zpracování „Přijatých“ Transakcí Vydání výskytu výkazu – provádí se pouze pro Vydání výskytu výkazu, na kterém jsou evidovány přijaté Transakce (aktuálně se týká pouze výkazu TRAFIM10).
* Zpracování „Čekajících“ Transakcí Vydání výskytu výkazu – provádí se pouze pro Vydání výskytu výkazu, na kterém jsou evidované čekající Transakce (aktuálně se týká pouze výkazu TRAFIM10).

Pro zpracování 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 ve Vydání výskytu výkazu záznamy Transakcí provedené v den, který se rovná Stav ke dni daného výskytu výkazu, jsou tyto záznamy Transakcí nastavený do stavu „Přijatá“ (received) a jsou zpracovány následující den.
* Pokud jsou zjištěny chyby v návaznosti zaslaných záznamů Transakcí, jsou tyto příslušné záznamy odmítnuty, není odmítnuto Vydání jako celek.
* Pokud jsou zjištěny chyby JVK, jejichž výsledek způsobuje zamítnutí Transakce, jsou odmítnuty příslušné záznamy Transakcí, není odmítnuto Vydání jako celek.
* Pokud jsou zjištěny pouze chyby JVK , jejichž výsledek způsobuje nastavení Transakce jako „Čekající“ (pending) , jsou příslušné záznamy Transakcí nastaveny do stavu „Čekající“ (pending).

Pro zpracování záznamů „Přijatých“ Transakcí Vydání výskytu výkazu platí následující pravidla (jelikož se tento proces týká nyní pouze výkazu TRAFIM10, je následující popis vztažen na potřeby zpracování tohoto výkazu):

* Zpracování je prováděno denně samostatnou akcí, která může být spuštěna v konkrétní plánovaný čas nebo po aktualizaci externích referenčních dat (aktuální externí číselník FIRDS\_FININSTRUMENT).
* Zpracování se provádí samostatně pro všechna Vydání výskytů výkazů, která obsahují „Přijaté“ Transakce. Zpracování těchto Vydání výskytu výkazů probíhá v pořadí, v jakém byla tato Vydání přijata, aby byla zajištěna návaznost zpracování záznamů Transakcí.
* V rámci tohoto zpracování se provádí kontroly JVK a formální kontroly návaznosti záznamů Transakcí pouze záznamů „Přijatých“ Transakcí.
* Výsledky zpracování se vyhodnocují stejně, jako v případě základního zpracování Vydání výskytu výkazu.

Pro zpracování „Čekajících“ Transakcí Vydání výskytu výkazu platí následující pravidla (jelikož se tento proces týká nyní pouze výkazu TRAFIM10, je následující popis vztažen na potřeby zpracování tohoto výkazu):

* Zpracování je prováděno denně samostatnou akcí, která se spouští po aktualizaci externích referenčních dat (aktuální externí číselník FIRDS\_FININSTRUMENT). V případě, že v určitý den nedojde k aktualizaci externích referenčních dat (výpadek procesu z jakýchkoliv důvodů), proběhne toto zpracování v konkrétní plánovaný čas.
* Zpracování se provádí samostatně pro všechna Vydání výskytů výkazů, která obsahují „Čekající“ Transakce.
* V rámci tohoto zpracování se provádí pouze vybrané kontroly JVK (mají nastaven atribut Opakovat = „FIRDS“ JVK „Čekajících“ Transakcí podle specifického algoritmu pro výkaz TRAFIM10.
* Výsledky zpracování se vyhodnocují stejně, jako v případě základního zpracování Vydání výskytu výkazu.
* Záznam Transakce může zůstat ve stavu „Čekající“, pokud nedošlo ke změně příslušných externích referenčních dat.
* Záznam Transakce se může změnit na stav „Akceptováno“, pokud nedošlo ke změně příslušných externích referenčních dat a všechny předepsané závažné JVK kontroly byly splněné.
* Záznam Transakce se může změnit na stav „Odmítnuto“, pokud došlo ke změně příslušných externích referenčních dat a byly zjištěné závažné chyby JVK nebo nedošlo ke změně externích referenčních dat a pro dané Vydání výkazu uplynul termín opakování JVK kontrol „Čekajících“ Transakcí.

### Protokoly o zpracování Vydání výskytu transakčního výkazu

#### Typy a formáty protokolů

K Vydání výskytu výkazu transakčního výkazu mohou vzniknout následující protokoly:

* Protokol o zpracování transakcí vydání
* Standardní protokol o základním zpracování Vydání výskytu výkazu – obsahuje výsledky formálních a formátových kontrol, formálních kontrol návazností záznamů Transakcí a výsledky JVK zaslaných Transakcí.
* K Vydání výskytu výkazu je vytvořen vždy 1 tento protokol (v příslušném formátu).
* Protokol o zpracování přijatých transakcí vydání
* Protokol o zpracování „Přijatých“ Transakcí Vydání výskytu výkazu – obsahuje výsledky formálních kontrol návazností záznamů Transakcí a výsledky JVK „Přijatých“ Transakcí.
* K Vydání výskytu výkazu je vytvořen vždy maximálně 1 tento protokol (v příslušném formátu), pokud Vydání obsahovalo „Přijaté“ Transakce.
* Protokol o zpracování čekajících transakcí vydání protokol o zpracování „Čekající
* Protokol o zpracování „Čekajících“ Transakcí Vydání výskytu výkazu – obsahuje výsledky JVK „Čekajících“ Transakcí.
* K Vydání výskytu výkazu je vytvořen tento protokol pro každé zpracování „Čekajících“ Transakcí, pokud došlo ke změně stavu nějaké „Čekající“ Transakce. Pokud v rámci zpracování „Čekajících“ Transakcí k žádné změně nedošlo, protokol není vytvořen.

Z hlediska formátu protokolu jsou vytvářeny protokoly podle toho, v jakém formátu bylo zasláno Vydání výskytu výkazu

* Vydání ve formátu XMLSDAT – vytvářeny jsou protokoly ve formátu XMLSDAT
* Vydání ve formátu ISO 200222 – vytvářeny jsou protokoly ve formátu ISO 20022 i XMLSDAT

#### Struktura protokolu

**Hlavička protokolu**

Element <Hlavicka> obsahuje informace o protokolu. Proti dosavadním protokolům je struktura beze změny.

Element <Nazev> obsahuje název protokolu, ve kterém je rozlišeno, zda se jedná o základní zpracování Vydání výskytu výkazu, zpracování přijatých transakcí nebo zpracování čekajících transakcí.

Element <Verze> obsahuje hodnotu 1.1.0 vzhledem k tomu, že dochází k rozšíření a změnám protokolů, které ale nemají dopad na protokoly dosavadních statistických výkazů.

**Zpracované vydání**

Element <VydaniPrehled> obsahuje atributy zpracovaného Vydání výskytu výkazu.

Element <ZpracovaniVydani> obsahuje výsledky o zpracování Vydání výskytu výkazu.

Proti dosavadním protokolů pro statistické výkazy dochází k následujícím rozšířením.

Souhrn zpracování

Element <SouhrnZpracovani> obsahuje statistiku zpracování zaslaných záznamů Transakcí v daném Vydání výskytu výkazu.

Statistika obsahuje následující informace:

* CELKEM – celkový počet zaslaných záznamů Transakcí (součet nových a zrušených záznamů Transakcí) v daném Vydání výskytu výkazu
* AKCEPTOVANO – aktuální počet akceptovaných záznamů Transakcí po provedení zpracování daného Vydání výskytu výkazu
* ODMITNUTO – aktuální počet odmítnutých záznamů Transakcí po provedení zpracování daného Vydání výskytu výkazu
* PRIJATO – aktuální počet přijatých záznamů Transakcí po provedení zpracování daného Vydání výskytu výkazu. Tato informace je obsažena pouze v případě, že Vydání výskytu výkazu obsahuje nějaké „Přijaté“ Transakce.
* CEKAJICI – aktuální počet čekajících záznamů Transakcí po provedení zpracování daného Vydání výskytu výkazu. Tato informace je obsažena pouze v případě, že Vydání výskytu výkazu obsahuje nějaké „Čekající“ Transakce.

Příklad:

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCEPTOVANO</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>0</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

Celkový výsledek zpracování

Element <VysledekZpracovani> obsahuje informaci o celkovém výsledku zpracování Vydání výskytu výkazu.

* AKCEPTOVANO – všechny zaslané záznamy Transakcí byly akceptovány.
* ODMITNUTO – Vydání výskytu výkazu je odmítnuto jako celek na formální/formátové chyby nebo byly všechny zaslané záznamy Transakcí odmítnuty.
* CASTECNE – Vydání výskytu výkazu obsahuje záznamy Transakcí s různým výsledkem zpracování.

Krok zpracování

Element <KrokZpracovani> obsahuje informace o k dílčímu kroku zpracování Vydání výskytu výkazu, který je uveden v elementu <KrokNazev>

* VYD – formální a formátové kontroly Vydání výskytu výkazu
* FKZ – formální kontroly návaznosti záznamů Transakcí
* JVK – jednovýkazové kontroly záznamů Transakcí

Element <VysledekZpracovani> obsahuje informace o výsledku zpracování daného kroku.

Chyby zpracování

Element <ChybyZpracovani> obsahuje zjištěné chyby k danému kroku.

Pro krok VYD (formální a formátové chyby Vydání výskytu výkazu) nedochází ke změně proti dosavadnímu stavu.

Pro kroky FKZ (formální kontroly návaznosti záznamů Transakcí) a JVK (jednovýkazové kontroly záznamů Transakcí) dochází k podstatné změně proti statistickým výkazům, chyby nejsou v protokolu sestaveny podle jednotlivých chybných Kontrol, ale podle chybných záznamů Transakcí.

Element <ChybnyZaznam> obsahuje identifikaci chybného záznamu a k tomuto záznamu dále seznam zjištěných chyb.

Element <DatovaOblast> obsahuje kód hlavní nebo rušící Datové oblasti transakčního výkazu (např. TRAF10\_11).

Element <DynaPar> obsahuje řetězec identifikující konkrétní záznam ve formě seznamu dynamických parametrů a jejich hodnot .

Příklad: Řetězec obsahuje hodnotu technického parametru T0019 i hodnoty transakčních parametrů R0011, R0012.

<DynPar>T0019:1,R0011:TRANSAKCE1,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

Element <StavZazanamu> obsahuje stav daného záznamu Transakce na základě vyhodnocení kontrol. Pokud je záznam odmítnut, obsahuje hodnotu ‘ODMITNUTO‘, pokud je ve stavu čekající, obsahuje hodnotu ‘CEKAJICI‘.

V protokolu o zpracování čekajících transakcí jsou uváděny i akceptované záznamy, které byly v daném procesu akceptovány. V tomto případě je stav záznamu ‘AKCEPTOVANO‘.

Element <Chyba> obsahuje seznam zjištěných chyb k daném záznamu Transakce. Uveden je <Kod>, <Zavaznost> a <Text>.

Element <Lokalizace> uvádí podrobnější informace k lokalizaci chyby.

Pokud se kontrola týká záznamu hlavní nebo rušící Datové oblasti, obsahuje tento element pouze zopakování této identifikace.

Příklad:

<Lokalizace> <DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:5,R0011:TRANSAKCE3,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

Pokud se kontrola týká záznamu doplňkové Datové oblasti, obsahuje tento element identifikaci konkrétního záznamu v této Datové oblasti.

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_21</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0021:6,T0019:6,R0011:TRANSAKCE4,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

#### Příklady protokolů

**Protokol o zpracování transakcí vydání ve formátu XML SDAT**

Příklad 1 – všechny zaslané transakce jsou akceptovány

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>

<prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2021-11-26T16:39:06.211</CasVytvoreni>

<Typ>VYD</Typ>

<Nazev>Protokol o zpracování transakcí vydání 1</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>2581604</VydaniId>

<VykazKod>TRAFIM00</VykazKod>

<VykazNazev>Informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR </VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Testovací osoba 9999</OsobaNazev>

<StavKeDni>2021-11-26</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCRPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>ISO20022</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2021-11-26T16:32:49.645</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCEPTOVANO</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>0</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>VYD</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>FKZ</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>JVK</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

</ZpracovaniVydani>

Příklad 2 – výsledkem zpracování vydání jsou akceptované, odmítnuté, přijaté i čekající transakce

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>

<prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2021-11-26T15:52:36.101</CasVytvoreni>

<Typ>VYD</Typ>

<Nazev>Protokol o zpracování transakcí vydání 1</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>2581600</VydaniId>

<VykazKod>TRAFIM10</VykazKod>

<VykazNazev>Informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR</VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Testovací osoba 9999</OsobaNazev>

<StavKeDni>2021-11-26</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCRPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>ISO20022</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2021-11-26T15:47:16.387</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCEPTOVANO</Popis>

<Hodnota>1</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CEKAJICI</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>PRIJATO</Popis>

<Hodnota>1</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>6</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>VYD</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>FKZ</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>JVK</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>TRAF10\_11</DatovaOblast>

<DynPar>T0019:1,R0011:TRANSAKCE1,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

<StavZaznamu>CEKAJICI</StavZaznamu>

<Chyba>

<Kod>CON-411</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-411: "The instrument should be present in reference data for the trading date for the following transactions:

1. The transaction is executed on a trading venue within EEA (MIC code in field 36 belongs to a trading venue within the EEA);

2. The transaction is an OTC transaction in instrument admitted to trading (field 36 populated with 'XOFF') and field 47 and 48 are not populated;

3. The transaction is executed on a SI or an organised trading platform outside EEA and field 47 and 48 are not populated.

In the case of transactions on EEA venues (point 1 above), the instrument should be valid on the particular trading venue where the transaction was executed. In the case of the other transactions (point 2 and 3), the instrument should be valid on any (at least one) EEA trading venue or SI.

If no more than 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 7th day or before) the transaction shall be pending."

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0011:TRANSAKCE1,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

</ChybnyZaznam>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>TRAF10\_11</DatovaOblast>

<DynPar>T0019:3,R0011:TRANSAKCE2,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

<StavZaznamu>CEKAJICI</StavZaznamu>

<Chyba>

<Kod>CON-411</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-411: "The instrument should be present in reference data for the trading date for the following transactions:

1. The transaction is executed on a trading venue within EEA (MIC code in field 36 belongs to a trading venue within the EEA);

2. The transaction is an OTC transaction in instrument admitted to trading (field 36 populated with 'XOFF') and field 47 and 48 are not populated;

3. The transaction is executed on a SI or an organised trading platform outside EEA and field 47 and 48 are not populated.

In the case of transactions on EEA venues (point 1 above), the instrument should be valid on the particular trading venue where the transaction was executed. In the case of the other transactions (point 2 and 3), the instrument should be valid on any (at least one) EEA trading venue or SI.

If no more than 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 7th day or before) the transaction shall be pending."

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:3,R0011:TRANSAKCE2,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

</ChybnyZaznam>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>TRAF10\_11</DatovaOblast>

<DynPar>T0019:5,R0011:TRANSAKCE3,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

<StavZaznamu>ODMITNUTO</StavZaznamu>

<Chyba>

<Kod>CON-370</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-370: "This field is mandatory where: Field 36 is an EEA trading venue or trading platform outside the Union"</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:5,R0011:TRANSAKCE3,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>CON-571</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-571: "Field should not be populated in reports where the transmitting firm identification code is not populated for the buyer or seller (fields 26 and 27) and the firm deals on a matched principal capacity (i.e. value 'MTCH' populated in field 29) or an any other capacity (i.e. value 'AOTC' populated in field 29) unless the decision maker field is populated with the LEI of the executing entity."

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:5,R0011:TRANSAKCE3,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>CON-411</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-411: "The instrument should be present in reference data for the trading date for the following transactions:

1. The transaction is executed on a trading venue within EEA (MIC code in field 36 belongs to a trading venue within the EEA);

2. The transaction is an OTC transaction in instrument admitted to trading (field 36 populated with 'XOFF') and field 47 and 48 are not populated;

3. The transaction is executed on a SI or an organised trading platform outside EEA and field 47 and 48 are not populated.

In the case of transactions on EEA venues (point 1 above), the instrument should be valid on the particular trading venue where the transaction was executed. In the case of the other transactions (point 2 and 3), the instrument should be valid on any (at least one) EEA trading venue or SI.

If no more than 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 7th day or before) the transaction shall be pending."

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:5,R0011:TRANSAKCE3,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

</ChybnyZaznam>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>TRAF10\_11</DatovaOblast>

<DynPar>T0019:6,R0011:TRANSAKCE4,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

<StavZaznamu>ODMITNUTO</StavZaznamu>

<Chyba>

<Kod>CON-074</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-074: "In case the CONCAT code is used, the following characters are only allowed: Capital Latin letters, Numbers, #. It should be a string of exactly 20 characters where first two characters are letters, the next 8 characters are numbers and the remaining characters are letters or #, where 11th and 16th character are letters.

In case national identification number or passport number is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A-Z), numbers (0-9) as well as ?+? and ?-? in case the identifier starts with "FI" and "-" when the identifier starts with "LV". It can be a string of 3 to 35 characters, where first two characters are letters."

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_21</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0021:6,T0019:6,R0011:TRANSAKCE4,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>CON-411</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-411: "The instrument should be present in reference data for the trading date for the following transactions:

1. The transaction is executed on a trading venue within EEA (MIC code in field 36 belongs to a trading venue within the EEA);

2. The transaction is an OTC transaction in instrument admitted to trading (field 36 populated with 'XOFF') and field 47 and 48 are not populated;

3. The transaction is executed on a SI or an organised trading platform outside EEA and field 47 and 48 are not populated.

In the case of transactions on EEA venues (point 1 above), the instrument should be valid on the particular trading venue where the transaction was executed. In the case of the other transactions (point 2 and 3), the instrument should be valid on any (at least one) EEA trading venue or SI.

If no more than 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 7th day or before) the transaction shall be pending."

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:6,R0011:TRANSAKCE4,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

</ChybnyZaznam>

</ChybyZpracovani>

</KrokZpracovani>

</ZpracovaniVydani>

**Protokol o zpracování přijatých transakcí vydání ve formátu XMLSDAT**

Příklad 3 – jedna přijatá transakce byla akceptovaná

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>

<prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2021-11-27T15:35:24.201</CasVytvoreni>

<Typ>VYD</Typ>

<Nazev>Protokol o zpracování přijatých transakcí transakcí vydání 1</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>2581600</VydaniId>

<VykazKod>TRAFIM10</VykazKod>

<VykazNazev>Informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR</VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Testovací osoba 9999</OsobaNazev>

<StavKeDni>2021-11-26</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCRPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>ISO20022</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2021-11-26T15:47:16.387</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>RJCT</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ACPT</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>PDNG</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>TOTAL</Popis>

<Hodnota>6</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>VYD</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>FKZ</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>JVK</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

</ZpracovaniVydani>

**Protokol o zpracování čekajících transakcí vydání**

Příklad 4 – jedna čekající transakce byla akceptovaná a jedna zůstává beze změny

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>

<prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2021-11-27T15:55:24.201</CasVytvoreni>

<Typ>VYD</Typ>

<Nazev>Protokol o opakovaném zpracování čekajících transakcí vydání 1</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>2581600</VydaniId>

<VykazKod>TRAFIM10</VykazKod>

<VykazNazev>Informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR</VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Testovací osoba 9999</OsobaNazev>

<StavKeDni>2021-11-26</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCRPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>ISO20022</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2021-11-26T15:47:16.387</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCETOVANO</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CEKAJICI</Popis>

<Hodnota>1</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>6</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>VYD</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>FKZ</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>JVK</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>TRAF10\_11</DatovaOblast>

<DynPar>T0019:3,R0011:TRANSAKCE1,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

<StavZaznamu>AKCEPTOVANO</StavZaznamu>

</ChybnyZaznam>

</ChybyZpracovani>

</KrokZpracovani>

</ZpracovaniVydani>

Příklad 5 – jedna čekající transakce byla po uplynutí termínu opakovaní JVK kontrol odmítnuta

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>

<prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2021-12-03T15:45:24.201</CasVytvoreni>

<Typ>VYD</Typ>

<Nazev>Protokol o opakovaném zpracování čekajících transakcí vydání 1</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>2581600</VydaniId>

<VykazKod>TRAFIM10</VykazKod>

<VykazNazev>Informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR</VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Testovací osoba 9999</OsobaNazev>

<StavKeDni>2021-11-26</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCRPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>ISO20022</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2021-11-26T15:47:16.387</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCEPTOVANO</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CEKAJICI</Popis>

<Hodnota>1</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>6</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>VYD</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>FKZ</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>JVK</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>TRAF10\_11</DatovaOblast>

<DynPar>T0019:3,R0011:TRANSAKCE2,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

<StavZaznamu>ODMITNUTO</StavZaznamu>

<Chyba>

<Kod>CON-412</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>CON-412: ""The instrument should be present in reference data for the trading date for the following transactions:

1. The transaction is executed on a trading venue within EEA (MIC code in field 36 belongs to a trading venue within the EEA);

2. The transaction is an OTC transaction in instrument admitted to trading (field 36 populated with 'XOFF') and field 47 and 48 are not populated;

3. The transaction is executed on a SI or an organised trading platform outside EEA and field 47 and 48 are not populated.

In the case of transactions on EEA venues (point 1 above), the instrument should be valid on the particular trading venue where the transaction was executed. In the case of the other transactions (point 2 and 3), the instrument should be valid on any (at least one) EEA trading venue or SI.

If at least 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 8th day after the submission) the transaction shall be rejected."

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:3,R0011:TRANSAKCE2,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

</ChybnyZaznam>

</KrokZpracovani>

</ZpracovaniVydani>

## Zpracování číselníkového výkazu

### Výskyt číselníkového výkazu

Výskyty číselníkových výkazů budou vytvářeny podle definice vykazovacích povinností.

* Zpravidla mají 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 termínu je Výskyt výkazu uzavřen a nadále k němu nelze zasílat další Vydání.
* Výskyt výkazu obsahuje nový nepovinný atribut Termín uzavření, který obsahuje datum a řas uzavření Výskytu výkazu, pokud má být uzavřen.
* Uzavření Výskytu proběhne i v případě, kdy jsou k Výskytu evidovány chyby (zamítnuté „Položky číselníku“).
* Existence Výskytu, který byl uzavřen s chybami nemá mít vliv na konsolidaci dat Výkazu, ta probíhá průběžně v rámci zpracování každého Vydání výskytu výkazu s vyloučením chybných dat.
* Opravy odmítnutých „Položek číselníku“ nebo změny „Položek číselníku“ se zasílají v některém následujícím Výskytu, tzn. že proti statistickým výkazům nejsou 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 závažné JVK chyby, je zaslaný záznam odmítnut
* Pokud je ve Vydání zaslán záznam s klíčem, který v SDAT existuje, a jsou zjištěny závažné 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 závažné JVK chyby, je zaslaný záznam akceptován a v SDAT evidován jako platný.
* Pokud je ve Vydání zaslán záznam s klíčem, který v SDAT existuje, a nejsou zjištěny závažné 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 zrušení záznamu, je technický parametr T0025 konkretizován jako dynamický parametr v hlavní Datové oblasti.
* Změna parametrů klíče je realizována zasláním záznamu s parametrem T0025 = ‘X‘ (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

Zpracování Vydání výskytu číselníkového výkazu má pouze 1 část:

* Zpracování Vydání výskytu výkazu – standardní zpracování Vydání výskytu 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 je zaslán záznam s hodnotou T0025 = ‘X‘ (Storno) ke klíči, který nemá v SDAT platný záznam, je daný rušící záznam odmítnut.
* Pokud jsou zjištěny chyby závažné JVK, jsou odmítnuty příslušné záznamy „Položek číselníku“, není odmítnuto Vydání jako celek.

### Protokoly o zpracování Vydání číselníkového výkazu

#### Typy a formáty protokolů

K Vydání výskytu výkazu číselníkového výkazu mohou vzniknout následující protokoly:

* Protokol o zpracování vydání
* Standardní protokol o základním zpracování Vydání výskytu výkazu – obsahuje výsledky formálních a formátových kontrol, formálních kontrol návazností záznamů „Položek číselníku“ a výsledky JVK zaslaných „Položek číselníku“.

Protokoly jsou pouze ve formátu XMLSDAT.

#### Struktura protokolu

**Hlavička protokolu**

Element <Hlavicka> obsahuje informace o protokolu. Proti dosavadním protokolům je struktura beze změny.

Element <Nazev> obsahuje název protokolu.

Element <Verze> obsahuje hodnotu 1.1.0 vzhledem k tomu, že dochází k rozšíření a změnám protokolů, které ale nemají dopad na protokoly dosavadních statistických výkazů.

**Zpracované vydání**

Element <VydaniPrehled> obsahuje atributy zpracovaného Vydání výskytu výkazu.

Element <ZpracovaniVydani> obsahuje výsledky o zpracování Vydání výskytu výkazu.

Proti dosavadním protokolů pro statistické výkazy dochází k následujícím rozšířením.

Souhrn zpracování

Element <SouhrnZpracovani> obsahuje statistiku zpracování zaslaných záznamů „Položek číselníku“ v daném Vydání výskytu výkazu.

Statistika obsahuje následující informace:

* CELKEM – celkový počet zaslaných záznamů „Položek číselníku“ v daném Vydání výskytu výkazu
* AKCEPTOVANO –počet akceptovaných záznamů „Položek číselníku“ po provedení zpracování daného Vydání výskytu výkazu
* ODMITNUTO – počet odmítnutých záznamů „Položek číselníku“ po provedení zpracování daného Vydání výskytu výkazu

Příklad:

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCEPTOVANO</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>1</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

Celkový výsledek zpracování

Element <VysledekZpracovani> obsahuje informaci o celkovém výsledku zpracování Vydání výskytu výkazu.

* AKCEPTOVANO – všechny zaslané záznamy „Položek číselníku“ byly akceptovány.
* ODMITNUTO – Vydání výskytu výkazu je odmítnuto jako celek na formální/formátové chyby nebo byly všechny zaslané záznamy „Položek číselníku“ odmítnuty.
* CASTECNE – Vydání výskytu výkazu obsahuje záznamy „Položek číselníku“ s různým výsledkem zpracování.

Krok zpracování

Element <KrokZpracovani> obsahuje informace o k dílčímu kroku zpracování Vydání výskytu výkazu, který je uveden v elementu <KrokNazev>

* VYD – formální a formátové kontroly Vydání výskytu výkazu
* FKZ – formální kontroly návaznosti záznamů „Položek číselníku“
* JVK – jednovýkazové kontroly

Element <VysledekZpracovani> obsahuje informace o výsledku zpracování daného kroku.

Chyby zpracování

Element <ChybyZpracovani> obsahuje zjištěné chyby k danému kroku.

Pro krok VYD (formální a formátové chyby Vydání výskytu výkazu) nedochází ke změně proti dosavadnímu stavu.

Pro kroky FKZ (formální kontroly návaznosti záznamů „Položek číselníku“) a JVK (jednovýkazové kontroly záznamů „Položek číselníku“) dochází k podstatné změně proti statistickým výkazům, chyby nejsou v protokolu sestaveny podle jednotlivých chybných Kontrol, ale podle chybných záznamů „Položek číselníku“.

Element <ChybnyZaznam> obsahuje identifikaci chybného záznamu a k tomuto záznamu dále seznam zjištěných chyb.

Element <DatovaOblast> obsahuje kód hlavní Datové oblasti číselníkového výkazu (např. REFF10\_11).

Element <DynaPar> obsahuje řetězec identifikující konkrétní záznam ve formě seznamu dynamických parametrů a jejich hodnot .

Příklad: Řětezec obsahuje hodnotu technického parametru T0019 i hodnoty transakčních parametrů R00101, R00102, R0103, R0104.

<DynPar>T0019:2,R0101:CZISIN0000001,R0102:, R0103:, R0104:</DynPar>

Element <StavZazanamu> obsahuje stav daného záznamu „Položky číselniku“ na základě vyhodnocení kontrol. Pokud je záznam odmítnut, obsahuje hodnotu ‘ODMITNUTO.

Element <Chyba> obsahuje seznam zjištěných chyb k daném záznamu „Položky číselníku“. Uveden je <Kod>, <Zavaznost> a <Text>.

Element <Lokalizace> uvádí podrobnější informace k lokalizaci chyby.

Pokud se kontrola týká záznamu hlavní Datové oblasti, obsahuje tento element pouze zopakování této identifikace.

Příklad:

<Lokalizace> <DatovaOblastKod>REFF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:2,R0101:CZISIN0000001,R0102:, R0103:, R0104:</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

Pokud se kontrola týká záznamu doplňkové Datové oblasti, obsahuje tento element identifikaci konkrétního záznamu v této Datové oblasti.

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>REFF10\_21</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0021:1,T0019:2, R0101:CZISIN0000001,R0102:, R0103:, R0104:</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

#### Příklady protokolů

**Protokol o zpracování vydání ve formátu XML SDAT**

Příklad 1 – všechny zaslané záznamy jsou akceptovány

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>

<prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2021-11-26T17:39:06.211</CasVytvoreni>

<Typ>VYD</Typ>

<Nazev>Protokol o zpracování vydání 1</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>2581624</VydaniId>

<VykazKod>PERFIM30</VykazKod>

<VykazNazev>Informace o obchodech s investičními nástroji podle čl. 26 MiFIR </VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Testovací osoba 9999</OsobaNazev>

<StavKeDni>2021-11-26</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCRPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>XML</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2021-11-26T17:32:49.645</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCEPTOVANO</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>0</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>VYD</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>FKZ</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>JVK</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

</ZpracovaniVydani>

Příklad 2 – dva záznamy akceptovány, jeden zázanm odmítnut.

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8" standalone="yes"?>

<prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2021-11-267T17:52:36.101</CasVytvoreni>

<Typ>VYD</Typ>

<Nazev>Protokol o zpracování vydání 1</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>2581630</VydaniId>

<VykazKod>PERFIM30</VykazKod>

<VykazNazev>Informace o osobách</VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Testovací osoba 9999</OsobaNazev>

<StavKeDni>2021-11-26</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCRPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>ISO20022</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2021-11-26T17:47:16.387</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<SouhrnZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>AKCEPTOVANO</Popis>

<Hodnota>2</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>ODMITNUTO</Popis>

<Hodnota>1</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

<PolozkaSouhrnuZpracovani>

<Popis>CELKEM</Popis>

<Hodnota>3</Hodnota>

</PolozkaSouhrnuZpracovani>

</SouhrnZpracovani>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>VYD</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>FKZ</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>AKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani/>

</KrokZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>JVK</KrokNazev>

<VysledekZpracovani>CASTECNE</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>PERF30\_11</DatovaOblast>

<DynPar>T0019:2,R00109:,R00106:1000000000,R0107:,R0108:</DynPar>

<StavZaznamu>ODMITNUTO</StavZaznamu>

<Chyba>

<Kod>105</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li vyplněn údaj Identifikace právnické osoby - IČ (PERF30\_11.RFD0106), musí být vyplněn také údaj Identifikace právnické osoby - LEI kód (PERF30\_11.RFD0109).

</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>PERF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:2,R00109:,R00106:1000000000,R0107:,R0108:</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

</ChybnyZaznam>

</ChybyZpracovani>

</KrokZpracovani>

</ZpracovaniVydani>

## Zpracování mezivýkazových kontrol

### Plány a běhy skupin MVK

Plán skupiny MVK pro Výskyt se stejně jako u statistických výkazů vztahuje u transakčních výkazů k Výskytu výkazu vlastníka dané Skupiny MVK.

Na rozdíl od statistických výkazů však nemá věcnou roli (u statistického výkazu se vyhodnocuje Kvalita MVK všech Plánů MVK a podle toho splnění vykazovací povinnosti konkrétního Výskytu výkazu), ale má roli provozní.

Používání Plánů a Běhů MVK je následující:

* Pokud je založen Výskyt výkazu vlastníka Skupiny MVK, vytvoří se k němu i Plán skupiny MVK pro Výskyt.
* Při spuštění zpracování mezivýkazových kontrol je k tomuto Plánu skupiny MVK založen Běh skupiny MVK, ke kterému je vytvořen Protokol o zpracování mezivýkazových kontrol.
* Protože Výskyty transakčních výkazů se postupně uzavírají, uzavírají se i příslušné Plány skupiny MVK pro Výskyt ve smyslu že Běhy skupiny MVK se vždy vytváří pouze k poslednímu Výskytu výkazu dané Osoby z hlediska Stav ke dni. Pokud tedy Osoba zašle Vydání výkazu vlastníka skupiny MVK k vyššímu Stav ke dni, je k tomuto Výskytu výkazu vytvořen i Plán skupiny MVK a předchozí Plán skupiny MVK se považuje za uzavřený, tzn. nejsou k němu zakládány žádné další Běhy skupiny MVK.

Příklad:

Pokud Osoba zašle Vydání výskytu výkazu TRAFIM11 k 30.5.2022, vznikne k tomuto Výskytu výkazu Plán skupiny MVK.

K tomuto Plánu skupiny MVK je při spuštění mezivýkazových kontrol založen Běh skupiny MVK, ke kterému je vytvořen Protokol o zpracování mezivýkazových kontrol.

Pokud Osoba zašle Vydání výskytu výkazu TRAFIM11 k 1.6.2022, vnikne k tomuto Výskytu výkazu Plán skupiny MVK a a při dalším zpracování mezivýkazových kontrol je založen Běh skupiny MVK k tomuto Výskytu výkazu.

Pokud Osoba nezašle Vydání výskytu výkazu TRAFIM11 k 2.6.2022, nevznikne k tomuto datu Výskyt výkazu ani Plán skupiny MVK a další případný Běh skupiny MVk je vytvořen stále k Výskytu výkazu k 1.6.2022.

### Zpracování mezivýkazových kontrol

Vzledem k tomu, že Výskyty transakčních výkazů mají převážně denní nepravidelnou periodicitu, budou mezivýkazové kontroly transakčních výkazů spouštěny pravidelně 1x denně po uzavření Výskytů transakčních a číselníkových výkazů a po dokončení zpracování zaslaných Vydání výskytů výkazů.

Běh skupiny MVK pro Osobu je založen v případě, že nastane některá z následujících situací:

* Od posledního zpracovaného Běhu skupiny MVK bylo zasláno a úspěšně zpracováno Vydání výskytu výkazu k některému Výkazu ve Skupině MVK.
* Některá Transakce dané Osoby transakčního výkazu, který je členem Skupiny MVK ve stavu „Čekající“ (PDNG) byla převedena do stavu „Zamítnutá“ (RJCT).
* Transakce ve stavu „Čekající“ (PDNG) se účastní mezivýkazových kontrol, i když u nich nebyly dokončeny jednovýkazové kontroly. Pokud je taková Transakce později „Zamítnutá“, musí se provést nad daty dané Transakce opět mezivýkazové kontroly.
* U výkazu člena skupiny MVK, který není vlastníkem Skupiny MVK, jsou zpracovány Transakce vztahující se k Osobě provádějící obchod (dle R0012 Identifikační kód subjektu provádějícího obchod), která odpovídá Vykazující osobě u Výskytu výkazu vlastníka Skupiny MVK.

V rámci Běhu skupiny MVK se provádí kontroly nad platnými daty Transakcí s použitím platných dat číselníkových výkazů nebo případně platných dat statistických výkazů.

Předmětem zpracování Běhu skupiny MVK jsou Transakce, u nichž došlo k nějaké změně od posledního zpracování dané Skupiny MVK pro danou Osobu , nebo byly vyhodnoceny jako chybné z hlediska MVK..

K Běhu skupiny MVK je sestaven Protokol, který obsahuje chybné Transakce z hlediska MVK.

* .

### Protokol o zpracování mezivýkazových kontrol

#### Typy a formáty protokolů

K Běhu skupiny MVK transakčního výkazu mohou vzniknout následující protokoly:

* Protokol o zpracování mezivýkazových kotnrol
* Standardní protokol o zpracování mezivýkazových kontrol – obsahuje výsledky MVK zaslaných Transakcí.
* K Běu skupiny MVK je vytvořen vždy 1 tento protokol.

Protokoly jsou pouze ve formátu XMLSDAT.

#### Struktura protokolu

**Hlavička protokolu**

Element <Hlavicka> obsahuje informace o protokolu. Proti dosavadním protokolům MVK je struktura beze změny.

Element <Typ> obsahuje odnotu MVK.

Element <SkupinaMvk> obsahuje kód skupiny MVK.

Element <Nazev> obsahuje název protokolu.

Element <Verze> obsahuje hodnotu 1.1.0 vzhledem k tomu, že dochází k rozšíření a změnám protokolů, které ale nemají dopad na protokoly dosavadních statistických výkazů.

**Zpracované vydání**

Element <VydaniPrehled> obsahuje atributy posledníhoo Vydání výskytu výkazu vlastníka Skupiny MVK, které bylo zahrnuto do zpracování mezivýkazových kontrol.

Element <ZpracovaniVydani> obsahuje výsledky o zpracování mezivýkazových kontrol dané Skupiny MVK..

Celkový výsledek zpracování

Element <VysledekZpracovani> obsahuje informaci o celkovém výsledku zpracování mezivýkazových kontrol.

* AKCEPTOVANO – všechny platné Transakce byly akceptovány z hlediska MVK, tzn. nevyskytují se žádné závažné chyby.
* NEAKCEPTOVANO – byly zjištěny závažné chyby platných Transakcí z hlediska MVK.

Krok zpracování

Element <KrokZpracovani> obsahuje informace o k dílčímu kroku zpracování Vydání výskytu výkazu, který je uveden v elementu <KrokNazev>

* MVK – mezivýkazové kontroly záznamů Transakcí

Element <VysledekZpracovani> obsahuje informace o výsledku zpracování daného kroku.

Související výkaz

Element <SouvisejiciVykaz> je násobný a obsahuje kódy dalších výkazů, jejichž data byla zahrnuta do mezivýkazových kontrol.

Chyby zpracování

Element <ChybyZpracovani> obsahuje zjištěné chyby k danému kroku.

Pro krok MVK (mezivýkazové kontroly záznamů Transakcí) dochází k podstatné změně proti statistickým výkazům, chyby nejsou v protokolu sestaveny podle jednotlivých chybných Kontrol, ale podle chybných záznamů Transakcí (tedy stejně jako v případě JVK Transakcí).

Element <ChybnyZaznam> obsahuje identifikaci chybného záznamu Transakce a k tomuto záznamu dále seznam zjištěných chyb.

Element <DatovaOblast> obsahuje kód hlavní Datové oblasti transakčního výkazu (např. TRAF10\_11).

Element <DynaPar> obsahuje řetězec identifikující konkrétní záznam ve formě seznamu dynamických parametrů a jejich hodnot .

Příklad: Řetězec hodnoty transakčních parametrů R0011, R0012.

<DynPar>R0011:TRANSAKCE1,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

Element <StavZaznamu> obsahuje stav daného záznamu Transakce z hlediska MVK na základě vyhodnocení MVK kontrol. Pokud je záznam odmítnut, obsahuje hodnotu ‘ODMITNUTO.

Element <Chyba> obsahuje seznam zjištěných chyb k daném záznamu Transakce. Uveden je <Kod>, <Zavaznost> a <Text>.

Element <Lokalizace> uvádí podrobnější informace k lokalizaci chyby.

Pokud se kontrola týká záznamu hlavní Datové oblasti, obsahuje tento element pouze zopakování této identifikace (ovšem v tomto případě včetně hodnoty parametru T0019).

Příklad:

<Lokalizace> <DatovaOblastKod>TRAF10\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:5,R0011:TRANSAKCE3,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

Pokud se kontrola týká záznamu doplňkové Datové oblasti, obsahuje tento element identifikaci konkrétního záznamu v této Datové oblasti.

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF10\_21</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0021:6,T0019:6,R0011:TRANSAKCE4,R0012:391200AADNVKZ7FJ1A86</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

#### Příklady protokolů

Příklad 1 – chybné Transakce z hlediska MVK

Výřez protokolu

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?><prot:ProtokolZpracovaniVydani xmlns:prot="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1" xmlns:ds="http://www.w3.org/2000/09/xmldsig#" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:cz:cnb:sdat:schemas:Protokoly:v1 xsd/informacni\_sluzby/Protokoly.xsd">

<Hlavicka>

<CasVytvoreni>2022-03-09T16:49:14.334</CasVytvoreni>

<Typ>MVK</Typ>

<SkupinaMvk>TRAF11\_01</SkupinaMvk>

<Nazev>Protokol o zpracování mezivýkazových kontrol TRAF11\_01</Nazev>

<VerzeProtokolu>1.1.0</VerzeProtokolu>

</Hlavicka>

<VydaniPrehled>

<VydaniId>20008235</VydaniId>

<VykazKod>TRAFIM11</VykazKod>

<VykazNazev>Doplňkové informace o uzavřených, vypořádaných a zrušených obchodech a převodech</VykazNazev>

<OsobaKod>9999</OsobaKod>

<OsobaNazev>Technologický subjekt</OsobaNazev>

<StavKeDni>2022-03-07</StavKeDni>

<RozsahKod>S\_BCPZB</RozsahKod>

<MetodikaKod>MKT20201101</MetodikaKod>

<Format>XMLSDAT</Format>

<CisloVydani>1</CisloVydani>

<TypVydani>DATA</TypVydani>

<DatumPrijetiVydani>2022-03-07T14:22:56.94</DatumPrijetiVydani>

</VydaniPrehled>

<ZpracovaniVydani>

<VysledekZpracovani>NEAKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<KrokZpracovani>

<KrokNazev>MVK</KrokNazev>

<SouvisejiciVykaz>REFFIM10</SouvisejiciVykaz>

<SouvisejiciVykaz>PERFIM30</SouvisejiciVykaz>

<SouvisejiciVykaz>TRAFIM10</SouvisejiciVykaz>

<SouvisejiciVykaz>TRAFIM20</SouvisejiciVykaz>

<SouvisejiciVykaz>TRAFIM30</SouvisejiciVykaz>

<VysledekZpracovani>NEAKCEPTOVANO</VysledekZpracovani>

<ChybyZpracovani>

<ChybnyZaznam>

<DatovaOblast>TRAF30\_11</DatovaOblast>

<DynPar>R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

<StavZaznamu>ODMITNUTO</StavZaznamu>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.329\_2</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li vyplněný Identifikační kód osoby činící investiční rozhodnutí v rámci podniku (TRAF30\_11.FIM0313), potom se musí shodovat použitý typ identifikátoru - kontrola množiny hodnot údajů (TRAF30\_11.FIM0314, TRAF30\_11.FIM0315) oproti množině hodnot údajů (PERF30\_11.RFD0006, PERF30\_11.RFD0007).</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.327\_1</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li vyplněný Identifikační kód osoby přijímající pokyn v rámci podniku (TRAF30\_11.FIM0281), potom musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0107).</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.326\_1</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li ve výkazu TRAFIM30 Požadovaná protistrana identifikována pomocí LEI kódu (TRAF30\_11.FIM0264) musí být nalezena v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0109) v případě LEI kódu.</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.325\_2</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Pokud se nejedná o převzetí koncového zákazníka (TRAF30\_11.FIM0253=false) pak Identifikační kód zákazníka (TRAF30\_11.FIM0422) ve výkazu TRAFIM30 musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0106) v případě IČ.</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.328\_1</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li vyplněný Identifikační kód osoby odpovědné za provedení pokynu v rámci podniku (TRAF30\_11.FIM0284), potom musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0107).</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.325\_3</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Pokud se nejedná o převzetí koncového zákazníka (TRAF30\_11.FIM0253=false) pak Identifikační kód zákazníka FO (TRAF30\_11.FIM0304) ve výkazu TRAFIM30 musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0107) v případě identifikátoru FO.</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.327\_2</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li vyplněný Identifikační kód osoby přijímající pokyn v rámci podniku (TRAF30\_11.FIM0281), potom se musí shodovat použitý typ identifikátoru - kontrola množiny hodnot údajů (TRAF30\_11.FIM0282, TRAF30\_11.FIM0283) oproti množině hodnot údajů (PERF30\_11.RFD0006, PERF30\_11.RFD0007).</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.328\_2</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li vyplněný Identifikační kód osoby odpovědné za provedení pokynu v rámci podniku (TRAF30\_11.FIM0284), potom se musí shodovat použitý typ identifikátoru - kontrola množiny hodnot údajů (TRAF30\_11.FIM0285, TRAF30\_11.FIM0286) oproti množině hodnot údajů (PERF30\_11.RFD0006, PERF30\_11.RFD0007).</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.329\_1</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Je-li vyplněný Identifikační kód osoby činící investiční rozhodnutí v rámci podniku (TRAF30\_11.FIM0313), potom musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0107).</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.324\_1</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Identifikační kód zadavatele (TRAF30\_11.FIM0247) ve výkazu TRAFIM30 musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0109) v případě LEI kódu.</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.324\_2</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Identifikační kód zadavatele (TRAF30\_11.FIM0421) ve výkazu TRAFIM30 musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0106) v případě IČ.</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.325\_1</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Pokud se nejedná o převzetí koncového zákazníka (TRAF30\_11.FIM0253=false) pak Identifikační kód zákazníka (TRAF30\_11.FIM0303) ve výkazu TRAFIM30 musí být nalezen v rámci množiny osob zaslaných výkazem PERFIM30 - kontrola oproti hodnotám údaje (PERF30\_11.R0109) v případě LEI kódu.</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

<Chyba>

<Kod>TRAF11\_01.331</Kod>

<Zavaznost>Zavazna</Zavaznost>

<Text>Množina hodnot údajů Identifikace investičního nástroje (TRAF30\_11.FIM0255, TRAF30\_11.FIM0307, TRAF30\_11.FIM0308, TRAF30\_11.FIM0309) musí být nalezena v rámci množiny nástrojů zaslaných výkazem REFFIM10 - kontrola oproti množině hodnot údajů (REFF10\_11.R0101, REFF10\_11.R0102, REFF10\_11.R0103, REFF10\_11.R0104).</Text>

<Lokalizace>

<DatovaOblastKod>TRAF30\_11</DatovaOblastKod>

<Detail>

<DynPar>T0019:1,R0014:3PETR01V040121C00000,R0015:254900DYKC0I0ATKAI31</DynPar>

</Detail>

</Lokalizace>

</Chyba>

</ChybnyZaznam>