



**NÁVRH**

# **Definice a formáty údajů pro hlášení obchodů**

<b>Číslo změny</b>	<b>Účinnost změny</b>	<b>Označení změněné části</b>	<b>Číslo verze po změně</b>	<b>Změnu provedl</b>
1.	10.05.2007	První zveřejnění definic údajů a formátů	0.1	Jirman
2.	22.10.2007	Úprava po vytvoření datového souboru v SDNS	0.2	Jirman
3.	31.01.2008	Úprava po vytvoření AII – Příloha č. 1	0.3	Jirman

**Datový soubor MOKAS40: Hlášení obchodů s investičními nástroji - OCP**  
**Datová oblast MOKA40 11: Hlášení obchodů - uzavření - OCP**

č.	Pole dle Přílohy č. 1 Nařízení	Formát pole	Možné hodnoty pole
1	Identifikace ohlašujícího podniku	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
2	Referenční číslo hlášení	Max23(x)	
3	Autor čísla hlášení	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
4	Cenová notace	3(a)	ISO 4217 - Currency Code
5	Den uskutečnění obchodu	10(x)	ISO 8601 Extended Date Format; YYYY-MM-DD
6	Čas uskutečnění obchodu	8(x)	ISO 8601 Time Format; HH:MM:SS
		S2(n)	ISO 8601 Time Zone Offset Format; +/-HH
7	Ukazatel nákupu/prodeje	1(a)	<b>B</b> = Buy <b>S</b> = Sell
8	Postavení	1(a)	<b>P</b> = Principal, Own Account <b>A</b> = Agent, Customer/Client Account
9	Identifikace nástroje (ISIN)	2(a)9(x)1(n)	ISO 6166 - International Securities Identification Number (ISIN)
10	Identifikace nástroje (All)	Max 50(x)	viz Příloha č. 1
11	Jednotková cena v měně	Max19(d)	
12	Jednotková cena v procentech	Max19(d)	
13	Množství/nominální hodnota	Max19(d)	
14	Protistrana	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
		4(x)	ISO 10383 - Market Identifier Code (MIC)
		Max 40(x)	Internal Code
15	Protistrana/zákazník	1(a)	<b>Y</b> = Counterparty is a Customer/client <b>N</b> = Counterparty is not a Customer/client
16	Identifikace místa	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
		4(x)	ISO 10383 - Market Identifier Code (MIC)
		4(x)	<b>XOFF</b> for Off the market
17	Referenční číslo obchodu	Max23(x)	
18	Autor čísla obchodu	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
		4(x)	ISO 10383 - Market Identifier Code (MIC)
19	Identifikace zákazníka	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
		Max 40(x)	Internal Code
20	Den vypořádání	10(x)	ISO 8601 Extended Date Format; YYYY-MM-DD
21	Objem obchodu	Max19(d)	

Všechna pole jsou povinná. V případě polí 9 a 10 resp. 11 a 12 je povinné vyplnění právě jednoho ze dvojice.

### **1. Identifikace ohlašujícího podniku**

Nařízení Komise (ES) č. 1287/2006 ze dne 10. srpna 2006, kterým se provádí směrnice Evropského parlamentu a Rady 2004/39/ES, pokud jde o evidenční povinnosti investičních podniků, hlášení obchodů, transparentnost trhu, přijímání finančních nástrojů k obchodování a o vymezení pojmů pro účely zmíněné směrnice (dále jen „prováděcí nařízení“): Jediný identifikační kód podniku, který provedl obchod.

*V rámci hlášení obchodů je jedinou možnou identifikací ohlašujícího obchodníka s cennými papíry BIC (dle ISO 9362) - SWIFT/Bank Identifier Code (existující osmimístný může být při neexistenci pobočky doplněn na devátém až jedenáctém místě XXX).*

*Formát: 11(x)*

### **2. Referenční číslo hlášení**

#### **3. Autor čísla hlášení**

*Jediné identifikační číslo hlášení obchodu, které mu přidělil obchodník s cennými papíry nebo třetí strana, podávající hlášení jeho jménem. Součástí hlášení bude i informace o osobě, která číslo přidělila (BIC).*

*Formát: Max 23(x)*

*Formát Autora čísla hlášení: 11(x)*

### **4. Cenová notace**

Prováděcí nařízení: Měna, v níž je vyjádřena cena. Pokud, jak je tomu v případě dluhopisu nebo jiné formy dluhového cenného papíru, je cena vyjádřena v procentech, je toto procento součástí hlášení.

*Pro označení měny je použit třímístný kód dle ISO 4217.*

### **5. Den uskutečnění obchodu**

Prováděcí nařízení: Den uskutečnění obchodu, kdy byl obchod proveden.

*Datum je uváděn ve formátu YYYY-MM-DD (dle ISO 8601 - Extended Date Format).*

*Formát: 10(x)*

### **6. Čas uskutečnění obchodu**

Prováděcí nařízení: Čas, kdy byl obchod proveden, nahlášený v místním čase příslušného orgánu, jemuž se obchod hlásí, přičemž časové pásmo místa, kde byl obchod proveden, je vyjádřeno ve tvaru koordinovaný univerzální čas (UTC) +/- hodin.

*Jedná se o místní čas příslušného orgánu včetně časové zóny. Čas je uváděn ve formátu HH:MM:SS včetně časové zóny +/-HH (dle ISO 8601).*

*Formát: 8(x)S2(n)*

### **7. Ukazatel nákupu/prodeje**

Prováděcí nařízení: Označuje, zda se jednalo o nákup nebo prodej z pohledu ohlašujícího investičního podniku, nebo z pohledu zákazníka, v případě ohlašování zákazníkovi.

*Označuje se z pohledu obchodníka s cennými papíry pro obchod na vlastní účet a z pohledu zákazníka pro obchod jménem a na účet zákazníka.*

*Způsob vyplnění:*

*B = Buy*

*S = Sell*

## **8. Postavení**

Prováděcí nařízení: Označuje, zda podnik provedl obchod: na vlastní účet (buď pod svým jménem, nebo jménem zákazníka); na účet a jménem zákazníka.

*Způsob vyplnění:*

*P = Principal, Own Account*

*A = Agent, Customer/Client Account*

## **Identifikace nástroje**

### **9. ISIN**

#### **10. AII**

Prováděcí nařízení: Skládá se z jedinečného kódu, který určí případný příslušný orgán, jemuž se podává hlášení, a který identifikuje finanční nástroj, jenž je předmětem obchodu; pokud předmětný finanční nástroj nemá jedinečný identifikační kód, musí hlášení uvádět název nástroje nebo, v případě derivátové smlouvy, znaky smlouvy.

*Obchodník s cennými papíry identifikuje investiční nástroj, který je předmětem hlášení obchodu, uvedením identifikačního označení podle mezinárodního systému číslování pro identifikaci cenných papírů (ISIN – dle ISO 6166). V případě, že ISIN není investičnímu nástroji přidělen (některé derivátové nástroje na některých regulovaných trzích), obchodník s cennými papíry identifikuje investiční nástroj uvedením alternativní identifikace tzv. AII – Alternative Instrument Identifier (viz Příloha č. 1). Může být vyplněn právě jeden z identifikátorů.*

*Formát: 2(a)9(x)1(n) nebo Max 50(x)*

## **Jednotková cena**

### **11. Jednotková cena v měně**

#### **12. Jednotková cena v procentech**

Prováděcí nařízení: Cena jednoho cenného papíru nebo derivátové smlouvy bez provize a naběhlých úroků. V případě dluhového nástroje může být cena vyjádřena buď absolutně (v jednotkách měny) nebo relativně (v procentech).

*U dluhových nástrojů ČNB požaduje relativní vyjádření ceny, v případě futures na index obchodovaných v bodech se jedná o cenu vyjádřenou v měně (počet bodů násobený hodnotou bodu v měně). Může být vyplněn pouze jeden z údajů o ceně.*

*Formát: Max19(d)*

### **13. Množství/ nominální hodnota**

Prováděcí nařízení: Počet jednotek finančních nástrojů, nominální hodnota dluhopisů nebo počet derivátových smluv, které jsou součástí obchodu.

*U dluhových nástrojů ČNB požaduje celkovou nominální hodnotu obchodu.*

*Formát: Max19(d)*

## **14. Protistrana**

### **15. Protistrana/zákazník**

Prováděcí nařízení: Identifikační údaje protistrany v obchodu. Součástí identifikačních údajů musí být:

- pokud je protistrana investičním podnikem, jedinečný kód tohoto podniku, který mu přidělil příslušný orgán, jemuž se hlášení podává;
- pokud je protistrana regulovaným trhem nebo mnohostranným obchodním systémem nebo subjektem, který vystupuje jako ústřední protistrana, musí být součástí údajů jedinečný harmonizovaný identifikační kód tohoto trhu, mnohostranného obchodního systému či subjektu vystupujícího jako ústřední protistrana podle seznamu zveřejněného příslušným

orgánem domovského členského státu tohoto subjektu podle čl. 13 odst. 2 prováděcího nařízení;

- pokud protistrana není investičním podnikem (*obchodníkem s cennými papíry*), regulovaným trhem, ani mnohostranným obchodním systémem, ani subjektem vystupujícím v roli ústřední protistrany, měla by se nazývat "zákazník či klient" investičního podniku, který obchod provedl.

*V případě, že se jedná o „zákazníka či klienta“ dle prováděcího nařízení, bude hlášení obsahovat i jednoznačné označení skutečnosti, že protistranou je zákazník. K samotné identifikaci bude použit buď mezinárodní identifikační kód BIC nebo identifikační číslo (8 míst) nebo rodné číslo zákazníka. Pokud takové číslo neexistuje, obchodník s cennými papíry použije k identifikaci náhradní identifikační číslo přidělené osobou vedoucí centrální evidenci cenných papírů nebo použije jedinečného čísla přiděleného zákazníkovi způsobem stanoveným vnitřními předpisy obchodníka s cennými papíry. V případě přidělení jedinečného čísla obchodníkem s cennými papíry, musí v hlášení obchodů prvních jedenáct znaků identifikace (ze čtyřiceti možných) obsahovat BIC obchodníka (viz Identifikace zákazníka).*

*Formát: 11(x) nebo 4(x) nebo Max40(x)*

*Způsob vyplnění Protistrana/zákazník:*

*Y = Counterparty is a Customer/client*

*N = Counterparty is not a Customer/client*

## **16. Identifikace místa**

Prováděcí nařízení: Identifikace místa, kde byl obchod realizován. Součástí identifikačních údajů musí být: pokud je tímto místem obchodní systém: jeho jedinečný harmonizovaný identifikační kód; v ostatních případech: kód "XOFF".

*V případě regulovaných trhů a mnohostranných obchodních systémů je pro identifikaci použit MIC (dle ISO 10383) - Market Identifier Code, v případě systematického internalizátora se bude jednat o BIC.*

*Formát: 11(x) nebo 4(x)*

## **17. Referenční číslo obchodu**

### **18. Autor čísla obchodu**

Prováděcí nařízení: Jedinečné identifikační číslo obchodu, které mu přidělil investiční podnik nebo třetí strana, podávající hlášení jeho jménem.

*Pole bude obsahovat referenční číslo obchodu přidělené místem (regulovaným trhem, mnohostranným obchodním systémem nebo vypořádacím systémem), kde se transakce uskutečnila. V případě, že taková identifikace neexistuje nebo není obchodníkovi s cennými papíry dostupná, přidělí referenční číslo obchodu obchodník s cennými papíry dle svých vnitřních předpisů. Toto číslo musí být shodné s údajem v deníku obchodníka s cennými papíry. V rámci hlášení obchodů je předávána i informace o osobě, která referenční číslo obchodu přidělila (BIC nebo MIC).*

*Formát: Max 23(x)*

*Formát Autora čísla obchodu: 11(x) nebo 4(x)*

### **19. Identifikace zákazníka**

Prováděcí n: Identifikační údaje zákazníka, pro něž byl obchod realizován.

*V případě, že zákazníkem byla osoba mající mezinárodní identifikační kód BIC, bude pole obsahovat tuto identifikaci. V ostatních případech bude toto pole obsahovat buď identifikační číslo(8 míst) nebo rodné číslo zákazníka. Pokud takové číslo neexistuje, obchodník s cennými papíry použije k identifikaci náhradní identifikační číslo přidělené osobou vedoucí centrální evidenci cenných papírů nebo použije jedinečného čísla přiděleného zákazníkovi způsobem stanoveným vnitřními předpisy obchodníka s cennými papíry. V případě přidělení jedinečného*

čísla obchodníkem s cennými papíry musí v hlášení obchodů prvních jedenáct znaků identifikace (ze čtyřiceti možných) obsahovat BIC obchodníka. Pole bude obsahovat identifikaci zákazníka i v případě obchodu na vlastní účet pro zákazníka. Identifikací zákazníka bude vyplněna i pro transakce na vlastní účet pro sebe, identifikací bude BIC obchodníka s cennými papíry. Pokud bude provedena transakce na vlastní účet pro cizího pro více než jednu osobu, bude použita interní identifikace s textem „MORE CLIENTS“; tento text nesmí být použit k žádné jiné interní identifikaci.

Formát: 11(x) nebo Max40(x)

#### **20. Den vypořádání**

Předpokládaný den, kdy dojde k vypořádání obchodu.

Datum je uváděn ve formátu YYYY-MM-DD (dle ISO 8601 - Extended Date Format).

Formát: 10(x)

#### **21. Objem obchodu**

Celkový objem obchodu (včetně naběhlých úroků v případě dluhopisů) v měně dle pole „Cenová notace“.

Formát: Max19(d)

Zkratky u formátů:

a = letter, d = decimal number, x = alphanumeric, n = digit, S = sign

Max 40(x): a maximum of 40 alphanumeric characters, podobně

Max 19 (d): a maximum of 19 digits (5 of them can be decimals numbers)

**Názvy a popis jednotlivých polí v celém materiálu vychází z českého překladu Nařízení, v případě hlášení obchodů je text doplněný ČNB označen kurzívou.**

**Datový soubor MOKAS40: Hlášení obchodů s investičními nástroji - OCP**  
**Datová oblast MOKA40 21: Hlášení obchodů - zrušení - OCP**

č.	Název pole	Formát pole	Možné hodnoty pole
1	Identifikace ohlašujícího podniku	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
2	Referenční číslo rušeného hlášení	Max23(x)	
3	Autor čísla rušeného hlášení	11(x) 4(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC) ISO 10383 - Market Identifier Code (MIC)
4	Referenční číslo hlášení	Max23(x)	
5	Autor čísla hlášení	11(x)	ISO 9362 - SWIFT/Bank Identifier Code (BIC)
6	Zrušení obchodu/hlášení	1(a)	<b>R</b> = zrušení hlášení (report) <b>T</b> = zrušení obchodu (trade)

Všechna pole jsou povinná.

**1. Identifikace ohlašujícího podniku**

Jedinečný identifikační kód podniku, který provedl obchod.

*V rámci hlášení obchodů je jedinou možnou identifikací ohlašujícího obchodníka s cennými papíry BIC (dle ISO 9362) - SWIFT/Bank Identifier Code (existující osmimístný může být při neexistenci pobočky doplněn na devátém až jedenáctém místě XXX).*

*Formát: 11(x)*

**2. Referenční číslo rušeného hlášení**

**3. Autor čísla rušeného hlášení**

*Jedinečné identifikační číslo rušeného hlášení obchodu, které mu přidělil obchodník s cennými papíry nebo třetí strana, podávající hlášení jeho jménem. Součástí hlášení bude i informace o osobě, která referenční číslo rušeného hlášení přidělila (BIC nebo MIC).*

*Formát: Max 23(x)*

*Formát Autora čísla rušeného hlášení: 11(x) nebo 4(x)*

**4. Referenční číslo hlášení**

**5. Autor čísla hlášení**

*Jedinečné identifikační číslo hlášení o zrušení obchodu, které mu přidělil obchodník s cennými papíry nebo třetí strana, podávající hlášení jeho jménem. Součástí hlášení bude i informace o osobě, která referenční číslo hlášení přidělila (BIC).*

*Formát: Max 23(x)*

*Formát Autora čísla hlášení: 11(x)*

**6. Zrušení obchodu/hlášení**

*Informace o tom, zda se jedná o zrušení nahlášeného obchodu (T) nebo o zrušení hlášení o uzavřeném obchodu (R).*

*Způsob vyplnění:*

*R = zrušení hlášení (report)*

*T = zrušení obchodu (trade)*



## Příloha č. 1: **Alternative Instrument Identifier (AII)**

Na základě podnětu Evropské federace burz (FESE) stanovil Evropský výbor regulátorů cenných papírů (CESR) strukturu Alternative Instrument Identifier (AII), identifikátor se skládá ze šesti prvků uvedených níže. Tento způsob identifikace se dotýká investičních nástrojů, které jsou standardizované deriváty obchodované na regulovaném trhu ve státě tvořícím Evropský hospodářský prostor, nepřiděluje-li organizátor tohoto regulovaného trhu obchodovaným investičním nástrojům kód ISIN. Seznam regulovaných trhů, které používají k identifikaci kód AII je k dispozici na webových stránkách Evropského výboru regulátorů cenných papírů (<http://mifidatabase.cesr.eu/>).

### **Struktura AII:**

#### **Exchange Code**

Kód trhu, kde byl derivát přijat k obchodování.

#### **Exchange Product Code**

Kód derivátu přidělený trhem, kde byl přijat k obchodování. Tento kód je unikátně spojen s charakteristikami derivátu (podkladové aktivum, vypořádání, atd.)

#### **Derivative Type**

Rozlišení, zda se jedná o opci nebo futures (viz pole 12 v příloze č.1 Nařízení Evropské Komise č. 1287/2006).

#### **Put/Call Identifier**

Upřesnění, zda se jedná o opci na nákup nebo prodej (viz pole 13 v příloze č.1 Nařízení Evropské Komise č. 1287/2006).

#### **Expiry/Delivery/Prompt Date**

Datum realizace/datum splatnosti derivátu (viz pole 11 v příloze č.1 Nařízení Evropské Komise č. 1287/2006).

#### **Strike Price**

Realizační cena derivátu (viz pole 14 v příloze č.1 Nařízení Evropské Komise č. 1287/2006).

### **Možné formáty a obsah jednotlivých polí AII dle dohody mezi CESR a FESE:**

<b>Pole</b>	<b>Format</b>	<b>Obsah</b>
<b>Exchange Code</b>	4 alphanumeric characters	ISO 10383 - Market Identifier Code (MIC)
<b>Exchange Product Code</b>	1-12 alphanumeric characters	
<b>Derivative Type</b>	1 character	“O” (Option) – “F” (Futures)
<b>Put/Call Identifier</b>	1 character	“P” (Put) – “C” (Call) – “F” (Futures)
<b>Expiry/Delivery/Prompt Date</b>	10 characters	ISO 8601 Extended Date Format; YYYY-MM-DD
<b>Strike Price</b>	up to 19 characters including up to five decimals with a point as the decimal separator and without any leading or training zeros	Pro futures bude dle dohody CESR – FESE vyplněno „0“ (nula).

Výsledný formát **Alternative Instrument Identifier (AII)** je:

**CCCCPppppppppppppDIYYYY-MM-DDNnnnnnnnnnnnnnnn.nnnnn**

kde C je Exchange Code, P(p) je Exchange Product Code, D je Derivative Type, I je Put/Call Identifier, YYYY-MM-DD je určeno pro Expiry/Delivery/Prompt Date a N(n) je určeno pro Strike Price.

Velká písmena jsou povinná, malá písmena jsou nepovinná. Pole Exchange Product Code a Strike Price musí obsahovat alespoň jeden znak (0 v případě Strike Price pro futures). Pomlčky v datu jsou povinné, desetinná tečka je nepovinná (její užití závisí na hodnotě Strike Price).