

POPIS DATOVÉHO SOUBORU**Kód:** DOCOS51**Akronym:** OCP (ČNB) 51-04**Název:** Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech**Charakteristika:**

Datový soubor obsahuje údaje o obchodech, které obchodník s cennými papíry uzavřel nebo obstaral prostřednictvím regulovaných trhů nebo jiných osob, a o přijatých pokynech k obstarání koupě, prodeje nebo jiného převodu investičních nástrojů a obchodů uzavřených na základě těchto pokynů na účet zákazníka nebo na vlastní účet za příslušné období.

Části datového souboru:**Část:** 1 - Obchodování s inv. nástroji jinými než deriváty**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	DOC050_11	Údaje o pokynech (inv. nástroje jiné než deriváty)
2	DOC050_12	Údaje o obchodech (inv. nástroje jiné než deriváty)

Část: 2 - Obchodování s deriváty**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	DOC050_21	Údaje o pokynech (deriváty)
2	DOC050_22	Údaje o obchodech (deriváty)
3	DOC050_23	Údaje o obchodech (OTC deriváty)

Část: 3 - Osoby**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	DOC050_33	Údaje o osobách

Vykaz.povinnost: VP_DOCOS51**Název** : Vykazovací povinnost pro DOCOS51**Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:**

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0002	Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt	E	Z_OCPBANKY	OCP - Banky a org. složky zahraničních bank
P0046	Rozsah vykazování podle území	=	S_BCPZB	Údaje za ČR a zahraničí
P0053	Stav ke dni	E	d1_I1	Datum ve tvaru YYYYMMDD z přípustného intervalu

Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0060	Termín předkládání	=	97_1	Po vzniku rozhodné skutečnosti

Kód: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech

Poznámka:

Pokyny pro podávání hlášení :

Obchodník s cennými papíry informuje Českou národní banku v elektronické podobě ve formě datové zprávy vypracované podle standardizovaných datových formulářů, jejichž elektronická podoba je zveřejněna na internetových stránkách České národní banky.

Standardizovaný datový formulář je ve formátu .xls a je určen k hromadnému zpracování dat. Proto nedoporučujeme umísťovat jakékoliv dodatečné informace mimo vyznačené datové oblasti. Struktura formuláře nesmí být žádným způsobem pozměněna, tj. nelze měnit názvy položek či listů, vkládat či posunovat sloupce nebo řádky uvnitř datové oblasti atp. Pokud obchodník uzná za vhodné, může (s ohledem zejména na velikost souboru a rozsah listu) přidat vlastní pomocné sloupce, zejména za účelem provázanosti záznamů s vlastními systémy. Tyto sloupce musí být připojeny až na konec datové oblasti, jejich názvy nesmí kolidovat s názvy povinných sloupců (doporučuje se používat názvy např. "Komentář" nebo "Poznámka" atp.) a při automatickém zpracování budou ignorovány. Soubor, ani jeho jednotlivé listy nebo buňky nesmí být uzamčeny. Soubor nesmí obsahovat makra, která se spouští při událostech, zejména při otevření souboru, aktivaci listů atp.

Obchodník s cennými papíry může rovněž využít standardizovaného datového formuláře ve formátu .mdb. V případě použití databázového souboru, musí být tento plně přístupný pro zpracování. Pravidla pro vyplňování polí jsou stejná jako v případě .xls souborů, názvy tabulek musí být přesně ve tvaru

```
tdXXXXXXXX_Nederivaty_Pokyn04_01
tdXXXXXXXX_Nederivaty_Obchod04_02
tdXXXXXXXX_Derivaty_Pokyn04_03
tdXXXXXXXX_Derivaty_Obchod04_04
tdXXXXXXXX_Derivaty_OTC04_05
tdXXXXXXXX_Udaje_Osoby04_06
```

kde XXXXXXXX je IČ obchodníka. Databáze nesmí obsahovat žádné jiné tabulky, dotazy, formuláře, apod. než ty výše jmenované.

Obchodník s cennými papíry má možnost vykazovat údaje za sledované období i v kratších časových intervalech, nejméně však za jednotlivé měsíce. Toto řešení je vhodné při reportování velkého objemu dat. Pro jednoznačnost určení, které záznamy budou zařazeny do příslušného období je rozhodující datum a čas přijetí pokynu. V odůvodněných případech může obchodník zvolit jiný vhodný rozhodný časový údaj, musí však zvolit položku, která se vždy vyplňuje a musí být schopen zajistit úplnost vykazovaných záznamů. U OTC derivátů je rozhodnou položkou datum zobchodování. Obchodník zařadí do výkazu též záznamy z předcházejícího období, pokud došlo k aktualizaci těchto záznamů od posledního zaslání výkazu.

Odesílaný datový soubor musí mít standardizovaný název ve tvaru

XXXXXXXX_UO_YYOO.xls,

kde

XXXXXXXX představuje IČ obchodníka,
YY představuje poslední dvojčíslí roku vykazovaného období,
OO je kód období. Pro jednotlivé měsíce se použijí kódy 01, 02, 03, 04, 05, 06, 07, 08, 09, 10, 11, 12, pro čtvrtletí kódy 41, 42, 43, 44.

Příklad názvu souboru

Obchodník, který má hypotetické IČ 22222222 a bude zasílat výkaz za červenec 2003, nazve soubor 22222222_UO_0307.xls

Předmět e-mailu musí mít standardní název sestavený z názvu příložených souborů

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech**Poznámka:**

oddělených středníkem (např. 22222222_UO_0307.xls; 22222222_UO_0308.xls) a zpráva e-mailu musí být prázdná. Pokud je nutné sdělit jakékoli dodatečné informace (např. o tom, že zasílaný výkaz je opravou již jednou přijatého výkazu), je zapotřebí odeslat kopii celé zprávy i zaměstnanci České národní banky, který je zodpovědný za zpracování obdržených souborů s výkazy informační povinnosti.

Datovou zprávu s připojeným datovým souborem opatřenou zaručeným elektronickým podpisem založeným na kvalifikovaném certifikátu vydaném akreditovaným poskytovatelem certifikačních služeb zašle obchodník na adresu podatelna@cnb.cz .

Velikost celé zprávy včetně příloh nesmí překročit limit 10 MB. Soubory v příloze mohou být komprimovány, nicméně v případě vícenásobné komprese je nutné kontaktovat zaměstnance České národní banky, který je zodpovědný za zpracování obdržených souborů s výkazy informační povinnosti, a upozornit ho na doručení takového vícenásobně komprimovaného souboru.

Formuláře zaslané na jakoukoli jinou e-mailovou adresu nebo s jiným než předepsaným názvem, stejně tak jako zprávy bez zaručeného elektronického podpisu nebudou brány v potaz. Pokud obchodník s cennými papíry nemůže splnit stanovené podmínky pro zaslání výkazu elektronickou poštou (maximální velikost zprávy, elektronický podpis), může výkazy doručit na záznamovém médiu.

Obecné pokyny pro vyplňování výkazu:

V případě numerických položek, kdy je třeba vyjádřit skutečnost, že položka má nulovou hodnotu, musí být vyplněna nula, buňka nesmí zůstat prázdná (např. "Výše úplaty související s obstaráním nákupu" je nulová, tuto skutečnost je nutno vyjádřit hodnotou nula). Buňka zůstane prázdná pouze v případech, kdy její vyplnění nedává smysl (např. "Podkladové aktivum - spot rate" se nevyplní, není-li tato cena známa, neboť vyplnění nulou by poskytlo nepravdivou informaci).

V případě textových položek se buňky, jejichž vyplnění nedává smysl, nebo jejichž hodnotu nelze zjistit, vyplní hodnotou "N/A" (např. jméno u právnické osoby). Pokud by správnou hodnotou buňky byl prázdný řetězec, buňka se nevyplní.

Údaje o datumu a čase se oddělují do dvou položek, numerické vyjádření těchto položek je třeba přizpůsobit této okolnosti, tj. datový údaj musí být oddělen od desetinné části určující konkrétní časový údaj. Není-li datum známo, položka zůstane nevyplněna.

Vyplňované hodnoty se zaokrouhlují na v praxi používaný počet desetinných míst. Datový formulář je rozdělen do několika datových oblastí, přičemž v obou tabulkách pokynů musí být číslo pokynu unikátní, tzn. nesmí se v dané tabulce opakovat, musí mu náležet právě jeden pokyn (a nesmí zůstat nevyplněné). V tabulkách obchodů se naopak vícenásobný výskyt předpokládá, a to u obchodů, které se váží na jeden pokyn (např. operace typu repo, kde k pokynu stačí jeden řádek).

Identifikační číslo, resp. rodné číslo, v tabulce osob musí být taktéž unikátní a musí být vždy vyplněno. Tabulka osob musí obsahovat úplný seznam osob, které ve vykazovaných pokynech a obchodech za hlášené období vystupují jako zadavatel, investor nebo protistrana.

Datový formulář byl vytvořen s maximálním ohledem na stávající způsob (formát) zasílání dat Burze cenných papírů. Přestože je rozsah deníku obchodníka mnohem rozsáhlejší, vyskytuje se zde dost společných položek. U některých však bylo třeba upravit způsob vyplňování kódů, eventuálně upravit jejich délku. Před odesláním souboru je v zájmu obchodníka, aby si překontroloval nejen správnost

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech**Poznámka:**

použitých kódů či zkratk, ale i správnost formátu a délky položek.

Dalšími kontrolovanými údaji jsou datumové a časové položky. Kontrolovány jsou následující časové posloupnosti :

pokyny:

datum a čas přijetí pokynu $\leq$ lhůta platnosti pokynu

nederiváty obchody :

datum zobchodování $\leq$ datum sjednaného vypořádání

pro transakce typu "D" navíc datum a čas přijetí pokynu $\leq$ datum a čas předání pokynu $\leq$ datum a čas zobchodování a datum sjednaného vypořádání $\leq$ datum konečného vypořádání

deriváty obchody:

datum a čas přijetí pokynu $\leq$ datum a čas předání pokynu $\leq$ datum a čas zobchodování

datum zobchodování $\leq$ datum sjednaného vypořádání $\leq$ datum konečného vypořádání

OTC deriváty:

datum zobchodování $\leq$ start date $\leq$ platnost, maturita

Testuje se rovněž vyplnění identifikace investora v datové oblasti "Údaje o pokynech (inv. nástroje jiné než deriváty)" u typů transakce jiných než "C" a "J" a vyplnění identifikace investora a protistrany v datové oblasti "Údaje o obchodech (inv. nástroje jiné než deriváty)" u typu transakce "D" (zejména u rep nemusí být vyplněno).

Způsob záznamu pokynů/obchodů s nederiváty

1. Nerealizovaný obchod

V případě, že na základě pokynu nebyl uzavřen obchod, nevyplňuje se již tabulka obchodů.

2. Obchod na vlastní účet obchodníka

V případě, že se jedná o obchod na vlastní účet obchodníka, který není investiční službou, postupuje se jakoby osoba zadávající "pokyn" k obchodu na vlastní účet byla obchodník. Obchodník vyplní v tabulce pokynů údaje o přijetí pokynu jako "Požadovaný počet kusů", "Limitní objem", "Limitní cena", "Měna pokynu", "Lhůta platnosti pokynu", apod. ... a časové údaje. Tyto údaje představují interní pokyn oprávněné osoby k uzavírání obchodů na vlastní účet obchodníka osobě realizující tento pokyn (makléři). V tabulce obchodů vyplní jeden řádek, který bude mít shodné "Číslo pokynu obchodu". V kolonce "Účet" bude hodnota "1" a obchodník zde bude "zadavatelem" i "investorem". Plní-li však takto obchodník pokyn zákazníka z vlastní pozice, tabulka pokynů obsahuje údaje o tomto pokynu zákazníka.

3. Obchod na cizí účet

V případě obchodu na cizí účet vyplní obchodník příslušná pole v tabulce pokynů a jeden odpovídající řádek v tabulce obchodů. Osoba obchodníka zde nefiguruje. Sem bude spadat i případ prodeje a zpětného nákupu podílových listů, pokud tak obchodník činí na účet investiční společnosti, tato zde bude protistranou. V kolonce "Účet" bude hodnota "2".

4. Obchod na vlastní účet pro třetího

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech**Poznámka:**

V případě, že obchodník kupuje od zákazníka investiční nástroj či prodává zákazníkovi investiční nástroj ze svého účtu- tj. jako službu na vlastní účet pro třetího dle § 4 odst. 2 písm. c) zákona č. 256/2004 Sb., ve znění pozdějších předpisů, budou pokyny zákazníka v tabulce pokynů odpovídat dva řádky v tabulce obchodů, přičemž obchodník se na jednom řádku uvede jako investor ve vztahu k osobě se kterou uzavírá jako s protistranou obchod na vlastní účet, na druhém řádku se obchodník uvede jako protistrana k zákazníkovi, který je uveden v kolonce "IČ nebo RČ investora". Jeden řádek tedy poskytuje informace o obchodu na vlastní účet obchodníka (protistranou je zde třetí osoba), druhý pak o obchodu (převodu) mezi obchodníkem a zákazníkem (protistranou je zde sám obchodník). Na pořadí řádků zde nezáleží, důležitá je správnost vyplněných časových údajů.

Pokud obchodník na základě zákaznickova pokynu provádí na trhu dílčí nákupy na vlastní účet (s cílem nakumulovat papíry a poté je jednorázově převést zákazníkovi), analogicky se zaznamená pokyn od zákazníka a k němu v tabulce obchodů všechny dílčí obchody, které budou mít shodnou položku "Číslo pokynu obchodu" s pokynem klienta, na jehož základě jsou dílčí pokyny realizovány. Způsob záznamu je tedy shodný jako v předcházejícím případě (tedy v případě služby obchodování na vlastní účet pro třetího), pouze v tabulce obchodů budou pod stejným číslem pokynu obchodu uvedena všechna dílčí plnění (každé na jiném řádku), tzn. obchod obchodníka s protistranou zde bude rozdělen na více plnění. Existuje-li možnost dílčích nákupů přímo na účet zákazníka (analogie obchodu na cizí účet), bude k pokynu zákazníka existovat tolik záznamů v tabulce obchodů, kolik je dílčích plnění, nebude zde záznam o obchodu obchodníka s protistranou (osoba obchodníka zde nefiguruje).

Obdobně se postupuje v případě primární aukce či přijetí hromadných pokynů k exekuci, kde se použijí pravidla o zadávání hromadných pokynů. V kolonce "Účet" bude hodnota "4"

Bude-li pokyn plněn zčásti "přes vlastní účet" a zčásti přímo (na cizí účet), tedy kombinací výše uvedených způsobů, použijí se analogicky oba způsoby záznamu a u plnění na cizí účet bude kolonce "Účet" hodnota "2".

5. Asset management, hromadné pokyny

V případě asset managementu se uvede jako zadavatel "pokynu" osoba obchodníka, která "pokyn" pro zákazníka zadává, a do položky investor se uvede zákazník, na jehož účet má být daný obchod realizován.

Připouští-li smlouva o obhospodařování zadávání pokynu zákazníkem, bude tabulka pokynů obsahovat údaje o tomto pokynu. Pokud tuto možnost smlouva nepřipouští, pak obchodník vyplňuje údaje v tabulce pokynů v souladu s "pokynem", který dává oprávněná osoba osobě, pověřené realizací pokynu (makléři).

Pokyny v rámci asset managementu se zadávají jako obchody na cizí účet, osoba obchodníka se zde projeví pouze v poli zadavatel, v tabulce obchodů tedy bude jeden řádek.

Požizuje-li portfoliomanager investiční nástroje do portfolia zákazníka z vlastní pozice (nebo od zákazníka do vlastní pozice nakupuje), uvede se jako protistrana osoba obchodníka, eventuálně se postupuje jako v případě obchodu na vlastní účet pro třetího.

Jedná-li se o tzv. hromadné pokyny, postupuje se jako v případě obchodu na vlastní účet pro třetího. Hromadné pokyny se číslují v položce "Číslo pokynu obchodu" tak, že mají shodných prvních jedenáct znaků, poslední pětimístný identifikátor se čísluje vzestupně.. Obchodník zde má možnost vyplnit souhrnný hromadný pokyn s pětimístným identifikátorem 00000 a dílčí pokyny číslovat od 00001, nebo může souhrnný pokyn úplně vynechat a číslovat od 00001. Obchodník by se měl důsledně držet jedné z těchto variant..Pokud by v důsledku absence souhrnného hromadného pokynu nebylo možno uvést všechny požadované informace (například nelze rozepsat poplatky na jednotlivé zákazníky a k dispozici je pouze souhrnný údaj), souhrnný hromadný pokyn musí být uveden.

Pokud za účelem plnění hromadného pokynu obchodník provádí dílčí nákupy do své pozice, bude postupovat, jakoby šlo o postupné plnění pokynu, tj. jednomu

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech**Poznámka:**

záznamu v tabulce pokynů (tento však dle první z výše uvedených variant nemusí být zaznamenán) bude odpovídat více záznamů v tabulce obchodů se shodným číslem a s koncovým identifikátorem 00000. Tabulka pokynů dále obsahuje všechny záznamy (řádky) týkající se zamýšlené distribuce na jednotlivé zákaznické účty, kde se uvedou všechny relevantní údaje (mj. množství nástrojů zamýšlená k distribuci a odměna obchodníka). V tabulce obchodů se vyskytne jednak obchod(y) na účet obchodníka s protistranou (protistranami) kde je obchodník investorem a jednak všechny obchody (převody) ve prospěch jednotlivých zákazníků, kde je obchodník protistranou.

Jsou-li hromadné pokyny portfoliomanagera realizovány prostřednictvím jiného obchodníka, může (podle výše zvolené varianty) být v tabulce pokynů záznam o hromadném pokynu, kde bude investorem obchodník realizující pokyn (identifikátor 00000). Tento řádek nebude mít realizace v tabulce obchodů neboť portfoliomanager nemusí mít informace, za jakých podmínek pověřený obchodník pokyn realizoval. Pověřený obchodník pak bude protistranou vůči zákazníkům (investorům) v tabulce obchodů.

V kolonce "Účet" bude hodnota "3".

Obchodník, který přijímá hromadný pokyn od jiného obchodníka k nákupu a distribuci do portfolií zákazníků, postupuje jako v popsáném případě hromadného pokynu (na vlastní účet pro třetího). Zadavatelem zde bude obchodník-portfoliomanager. Vzhledem k tomu, že z pohledu přijímajícího obchodníka nejde o asset management, bude v kolonce "Účet" hodnota "4".

Pravidla pro evidenci hromadných pokynů se vztahují též např. na primární aukce, kde obchodník na vlastní účet (např. v rámci syndikátu) nakoupí a poté provede distribuci mezi zákazníky. V kolonce "Účet" bude hodnota "4" a jednotlivé pokyny zákazníků je třeba v tabulce pokynů vyplnit.

Pokud by v rámci asset managementu zadával portfoliomanager pokyn pro primární aukci jinému obchodníkovi (makléři), postupuje se jako ve výše popsáném případě, kde jsou hromadné pokyny realizovány prostřednictvím jiného obchodníka, v kolonce "Účet" bude hodnota "3".

6. Repo obchody

Repa, B/S a půjčky se ve smyslu definice vedlejší investiční služby poskytování úvěrů považují buď za obchod na vlastní účet (nejsou-li uzavírány se zákazníkem), v kolonce "Účet" bude hodnota "1" a obchodník je investorem, nebo se považují za obchod na vlastní účet pro třetího, v kolonce "Účet" bude hodnota "4" a investorem bude zákazník.

Směr "první nohy" je dán hodnotou pole "Směr pokynu" v tabulce pokynů a vztahuje se vždy k položce "IČ nebo RČ investora". Tato zásada platí vždy a obchodník musí správně vyplnit položku "Směr pokynu" s ohledem na to, jestli je sám investorem, nebo jestli je investorem jiná osoba. V tabulce obchodů se u zpětného obchodu (druhé nohy) neuvádí identifikace osob, neboť z předcházejících údajů jsou tyto jednoznačně určeny.

7. (Custody) převody

V případě custody převodu se nevyplňují pole "IČ nebo RČ investora", "Pozadovany trh", "Účet" "Lhůta pokynu", "Makléř...", "Realizovany trh" případně další položky, které nejsou k dispozici či nemají pro daný převod význam. Zadavatelem se rozumí osoba zadávající pokyn ke custody převodu. Ostatní položky v tabulce pokynů se vztahují k instrukci k převodu. Protistranou se rozumí vypořádací agent. "Předání pokynu - datum" a "Předání pokynu - čas" jsou okamžik zadání pokynu k převodu ze strany obchodníka (obvykle swiftová zpráva), "Zobchodování - datum" a "Zobchodování - čas" je časový údaj uskutečnění obchodu jehož důsledkem je custody převod, "Vypořádání - sjednané datum" a "Vypořádání - konečné datum" jsou požadované a skutečné datумы převodu požadovaného nástroje.

Pokyny a obchody se standardizovanými deriváty obchodovanými na regulovaném trhu

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech**Poznámka:**

Deriváty obchodované na regulovaných trzích se až na drobná specifika evidují stejným způsobem, jako nederiváty a přiměřeně se na ně aplikují i výše uvedené způsoby záznamu.

"Směr pokynu" může nabývat následujících hodnot: "1" = Nákup nebo jiné nabytí investičního nástroje, "2" = Prodej nebo jiné zcizení investičního nástroje, "3" = Nákup za účelem uzavírání pozice, "4" = Prodej za účelem otevírání pozice. Kódy "3" a "4" se aplikují v případě, kdy jsou zadávány do obchodního systému organizátora veřejného trhu.

Vzhledem k široké paletě derivátů je obchodníkovi ponechána určitá volnost v označení derivátu, k tomuto účelu slouží čtyři pole:

"Derivát - ID" slouží především obchodníkovi, aby měl možnost použít označení, které používá jeho informační systém a měl tedy i zpětnou kontrolu nad záznamy, eventuelně zde může být značení používané veřejným trhem či jiné obdobné označení.

Položkou "Derivát - název" se rozumí název, používaný na příslušném organizovaném trhu,

"Derivát - ticker" je kód derivátu používaný v systému organizátora veřejného trhu, v odůvodněných případech lze použít symbolů zavedených v analytických a informačních systémech.

"Derivát - typ, druh" znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, jako např. "BUY-Option", "Futures" atp. Toto označení a položka

"Derivát - ticker" jsou povinné, z ostatních položek obchodník vybere co lze vhodně aplikovat. Nevyužitá pole zůstanou volná.

U všech derivátů je třeba specifikovat jejich základní charakteristiky, mezi které patří množství podkladového aktiva na jednotku kontraktu (velikost kontraktu, "Podkladové aktivum - množství") event. jeho nominální hodnota, identifikace podkladového aktiva identifikačním číslem investičního nástroje podle mezinárodního systému číslování pro identifikaci investičních nástrojů, je-li přiděleno, nebo kód používaný obchodníkem pro toto aktivum ("Podkladové aktivum - ID"). Dále sem patří název podkladového aktiva, eventuelně kód měny (dle ISO4217), je-li podkladovým aktivem měna, eventuelně jiná výstižná specifikace podkladového aktiva ("Podkladové aktivum - název").

U opcí se uvede cena, za kterou může být nakoupeno podkladové aktivum v případě, že bude uplatněno právo vyplývající z derivátu (realizační cena), u futures termínová cena (kurz, sazba) podkladového aktiva ("Podkl aktivum Fw Strike Rate").

Platností ("Platnost Maturita") se rozumí datum expirace nebo datum prekluze práv z derivátu, u opčních kontraktů se jedná o termín vypršení opce, jinak se jedná o termín ukončení platnosti kontraktu.

Položka "Účet" zde má stejný význam jako u nederivátových obchodů neboť se i zde předpokládá výkon investičních služeb a tudíž, jedná li se o obchod se zákazníkem, budou vyplněny i příslušné údaje o pokynu. Způsob evidence je analogický jako u nederivátových pokynů.

Položka "IČ/RČ protistrany" se vyplňuje analogicky jako u nederivátů, v případech, kdy by se jednalo o organizátora trhu se nechává volné, pokud je organizátor specifikován v poli "Požadovaný trh".

Pro časové údaje se použijí přiměřeně pravidla nederivátové části.

Samotná expirace opce se neeviduje, exekuce opce, je-li podkladovým aktivem investiční nástroj, se zanáší do nederivátové části výkazu.

Pokyn je obdobně jako u nederivátů specifikován cenou nebo objemem, tento údaj se vztahuje k jednomu kontraktu. Je-li cenová dispozice dána pouze jedním cenovým údajem, vyplní se v položce "Cena 1", pro další cenový údaj se použije položka "Cena 2".

Evidence nestandardizovaných (OTC) derivátů

OTC deriváty se evidují ve zjednodušené zvláštní datové oblasti "Údaje o obchodech (OTC deriváty)", která se propojuje pouze s tabulkou osob. Pole "Číslo pokynu obchodu" má shodné parametry jako u předchozích evidencí, avšak nepočítá

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech**Poznámka:**

se zde s hromadnými pokyny a číslování se provádí i na posledních místech. Pole "Realizovaná cena" a "Měna - obchod" se vyplňují pouze v případech, kdy má kontrakt v době sjednávání cenu, kterou obchodník hradí (nebo obdrží), půjde typicky o opční prémie.

Pro označení derivátu jsou vyhrazena dvě pole:

"Derivát - ID" slouží především k vlastnímu (internímu) označení derivátu, může sloužit k propojení s informačním systémem obchodníka,

"Derivát - typ, druh" znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, jako např. "BUY-Option", "IRS FIX/FLOAT 6M" atp.

Položky "Podkladové aktivum - ID" a "Podkladové aktivum - název" se vyplní analogicky jako u derivátů veřejně obchodovaných, nebo zůstanou volné, pokud podkladovým aktivem není nástroj (obvykle cenný papír), na který by je bylo možno aplikovat.

"Podkladové aktivum - množství" je počet kusů podkladového aktiva, pokud by se kontrakt nevztahoval na jednu jednotku podkladového aktiva. V případě, že je podkladovým aktivem úrokový nebo měnový nástroj, uvede se nominální hodnota, na kterou se kontrakt vztahuje, nebo od které se odvozuje plnění.

U FX swapu odpovídá položka "Podkladové aktivum - spot rate" spotovému kurzu a "Podkladové aktivum - strike deal rate" forwardovému kurzu.

U FX transakcí se položka "Podkladové aktivum - spot rate" vztahuje k první měně měnového páru ("Podkladové aktivum - měna 1").

U FRA je "Podkladové aktivum - strike deal rate" sazba dohodnutá mezi obchodníky, "Podkladové aktivum - spot rate" je sazba, na jejímž základě dochází k plnění.

U opcí je "Podkladové aktivum - strike deal rate" cena, za kterou může být nakoupeno podkladové aktivum v případě, že bude uplatněno právo vyplývající z derivátu (realizační cena).

Směr transakce nemá samostatné pole a je dán znaménkem položky "Podkladové aktivum - množství" (+ pro nákup, - pro prodej).

Typ opce (call, put) se odvodí z položky "Derivát - typ, druh" a znaménka položky "Podkladové aktivum - množství".

"Zobchodování - datum", "Zobchodování - čas", "Start date", "Platnost, maturita" jsou data uzavření obchodu, počátku smluvního vztahu a vypršení smluvního vztahu. Ne vždy se tato data musí shodovat s daty vypořádání, v některých případech je nebude možné vyplnit (např. "Start date" u FX forwardu).

U složitějších konstrukcí, se jednotlivé položky vyplní pouze tam, kde mají význam, v položce poznámka se doplní stručný a výstižný komentář.

Forwardem se rozumí obchod, kde čas pro vypořádání překračuje zvyklosti trhu.

Označování derivátů

Položka "Derivát - typ, druh" je vždy povinná a je klíčová pro základní rozdělení derivátů. Znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, přičemž z označení nemusí vyplývat žádný údaj o podkladovém aktivu, tyto informace jsou obsaženy v dalších položkách. Předpokládá se následující označení nejběžnějších derivátů:

FX Forward

FX-Swap

BUY-Option

SELL-Option

FRA

IRS FIX/FLOAT 6M

CC IRS

Forward Akcie

Forward Bond

Futures

Jedná li se o složitější konstrukce, zejména OTC produkty na bázi opcí, jako např. caps, floors, options atp, používají se pro označení vžité event. výstižné

Kód: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech

Poznámka:
názvy.

Verze: 1.0	Stav: Platný	Platnost od: 01.01.2007
Zdroj: ČNB		
Garant věcného obsahu	:Frýdlová/odb.542	
Garant metodického popisu:	Frýdlová/odb.542	

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Název: Hlášení o uzavřených a obstaraných obchodech

Datová oblast: DOCO50_11

Název: Údaje o pokynech (inv. nástroje jiné než deriváty)

Charakteristika:

Datová oblast obsahující evidenci pokynů k uskutečnění obchodu, jejichž předmětem je nederivátový nástroj. Jednotlivé pokyny jsou jednoznačně určeny číslem pokynu.

Číslo pokynu obchodu je 16 místný textový údaj, jehož prvních 11 znaků tvoří jednoznačnou identifikaci pokynu, přijatého od zákazníka k obstarání investiční služby (k nákupu či prodeji investičního instrumentu). Zbylých 5 znaků slouží identifikaci hromadných pokynů. Nejde-li o hromadný pokyn (nebo obchod na základě hromadného pokynu), bude zde 5 nul, např. u OTC derivátů. Číslo pokynu se shoduje s čísly jednotlivých obchodů provedených na základě pokynu. Pokud bude pokyn od zákazníka uspokojován postupně (dílčími obchody), budou mít obchody na základě tohoto pokynu vždy shodných všech 16 znaků, čímž bude zajištěno jednoznačné přiřazení každého obchodu k pokynu, na jehož základě byl obchod uskutečněn. Sdružuje-li obchodník pokyny, budou mít jak sdružené pokyny, tak i vzniklý hromadný(é) pokyn(y) shodných prvních 11 znaků, zbylých 5 znaků bude číslováno od 00001 nebo od 00000. Typickým (ale ne výlučným) případem použití zde bude poskytování služeb v rámci "asset managementu", pokud portfoliomanager agreguje pokyny pro více zákazníků na základě stejné investiční strategie.

Pokud obchodník zprostředkovává obchod mezi svými dvěma zákazníky, zaznamená tento případ jako dva pokyny/obchody na cizí účet, pokaždé z pohledu jiného zákazníka.

Změny pokynů se zanáší jako zrušení původního pokynu (vyplní se odpovídající hodnota v položce "Stav") a zadání pokynu nového.

Položky "Přijetí pokynu - datum", "Přijetí pokynu - čas" znamenají okamžik, kdy se pokyn dostal do dispoziční sféry obchodníka (přijetí faxu, elektronické zprávy obsahující pokyn, vyplnění údajů při osobním podání pokynu apod.). V případě interního pokynu jde o okamžik předání pokynu osobou oprávněnou osobě pokyn realizující (makléři). Položka "Přijetí pokynu - datum" je rozhodující pro určení, které záznamy budou zahrnuty do výkazu pro příslušné období a proto musí být vyplněna vždy, ve výjimečných případech, kdy se údaje o pokynu nevyplňují se zde uvede údaj položky "Předání pokynu - datum". Lhůtou pokynu se rozumí poslední den platnosti pokynu. Časové údaje se zadávají s přesností alespoň na minuty.

V položkách "Makléř..." se uvádí příjmení všech makléřů, kteří prováděli odborné obchodní činnosti související s obchodem podle vyhlášky č 259/2004 Sb., o druzích odborných obchodních činností obchodníka s cennými papíry vykonávaných prostřednictvím makléře, o druzích odborné specializace makléře a o makléřské zkoušce, ve znění pozdějších předpisů. Například v případě asset managementu (vlastní realizace) bude uvedeno minimálně příjmení portfoliomanagera zadávajícího pokyn a příjmení makléře, který prováděl odborné obchodní činnosti v souvislosti s plněním pokynu.

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_11

Charakteristika:

Obecné pokyny pro vyplňování výkazu:

V případě numerických položek, kdy je třeba vyjádřit skutečnost, že položka má nulovou hodnotu, musí být vyplněna nula, buňka nesmí zůstat prázdná (např. je-li výše úplaty související s obstaráním nákupu nulová, tuto skutečnost je nutno vyjádřit hodnotou nula). Buňka zůstane prázdná pouze v případech, kdy její vyplnění nedává smysl (např. "Podkladové aktivum - spot rate" se nevyplní, není-li tato cena známa, neboť vyplnění nulou by poskytlo nepravdivou informaci).

V případě textových položek se buňky, jejichž vyplnění nedává smysl, nebo jejichž hodnotu nelze zjistit, vyplní hodnotou "N/A" (např. jméno u právnické osoby). Pokud by správnou hodnotou buňky byl prázdný řetězec, buňka se nevyplní.

Údaje o datumu a čase se oddělují do dvou položek, numerické vyjádření těchto položek je třeba přizpůsobit této okolnosti, tj. datový údaj musí být oddělen od desetinné části určující konkrétní časový údaj. Není-li datum známo, položka zůstane nevyplněna.

Vyplňované hodnoty se zaokrouhlují na v praxi používaný počet desetinných míst.

Datový soubor je rozdělen do několika datových oblastí, přičemž v obou tabulkách pokynů musí být číslo pokynu unikátní, tzn. nesmí se v dané tabulce opakovat, musí mu náležet právě jeden pokyn (a nesmí zůstat nevyplněné). V tabulkách obchodů se naopak vícenásobný výskyt předpokládá, a to u obchodů, které se váží na jeden pokyn (např. operace typu repo, kde k pokynu stačí jeden řádek).

Datový formulář byl vytvořen s maximálním ohledem na stávající způsob (formát) zasílání dat Burze cenných papírů. Přestože je rozsah deníku obchodníka mnohem rozsáhlejší, vyskytuje se zde dost společných položek. U některých však bylo třeba upravit způsob vyplňování kódů, eventuálně upravit jejich délku. Před odesláním souboru je v zájmu obchodníka, aby si překontroloval nejen správnost použitých kódů či zkratk, ale i správnost formátu a délky položek.

Dalšími kontrolovanými údaji jsou datumové a časové položky. U pokynů a obchodů týkajících se nederivátových nástrojů jsou kontrolovány následující časové posloupnosti :

pokyny:

datum a čas přijetí pokynu <= lhůta platnosti pokynu

obchody :

datum zobchodování <= datum sjednaného vypořádání

pro transakce typu "D" navíc datum a čas přijetí pokynu <= datum a čas předání pokynu <= datum a čas zobchodování a datum sjednaného vypořádání <= datum konečného vypořádání

Charakteristika:

Testuje se rovněž vyplnění identifikace investora v datové oblasti "Údaje o pokynech (inv. nástroje jiné než deriváty)" u typů transakce jiných než "C" a "J" a vyplnění identifikace investora a protistrany v datové oblasti "Údaje o obchodech (inv. nástroje jiné než deriváty)" u typu transakce "D" (zejména u rep nemusí být vyplněno).

Způsob záznamu pokynů/obchodů s nederiváty

1. Nerealizovaný obchod

V případě, že na základě pokynu nebyl uzavřen obchod, nevyplňuje se již tabulka obchodů.

2. Obchod na vlastní účet obchodníka

V případě, že se jedná o obchod na vlastní účet obchodníka, který není investiční službou, postupuje se jakoby osoba zadávající "pokyn" k obchodu na vlastní účet byla obchodník. Obchodník vyplní v tabulce pokynů údaje o přijetí pokynu jako "Požadovaný počet kusů", "Limitní objem", "Limitní cena", "Měna pokynu", "Lhůta platnosti pokynu", apod. ... a časové údaje. Tyto údaje představují interní pokyn oprávněné osoby k uzavírání obchodů na vlastní účet obchodníka osobě realizující tento pokyn (makléři). V tabulce obchodů vyplní jeden řádek, který bude mít shodné "Číslo pokynu obchodu". V kolonce "Účet" bude hodnota "1" a obchodník zde bude "zadavatelem" i "investorem". Plní-li však takto obchodník pokyn zákazníka z vlastní pozice, tabulka pokynů obsahuje údaje o tomto pokynu zákazníka.

3. Obchod na cizí účet

V případě obchodu na cizí účet vyplní obchodník příslušná pole v tabulce pokynů a jeden odpovídající řádek v tabulce obchodů. Osoba obchodníka zde nefiguruje. Sem bude spadat i případ prodeje a zpětného nákupu podílových listů, pokud tak obchodník činí na účet investiční společnosti, tato zde bude protistranou. V kolonce "Účet" bude hodnota "2".

4. Obchod na vlastní účet pro třetího

V případě, že obchodník kupuje od zákazníka investiční nástroj či prodává zákazníkovi investiční nástroj ze svého účtu - tj. jako službu na vlastní účet pro třetího dle § 4 odst. 2 písm. c) zákona č. 256/2004 Sb., ve znění pozdějších předpisů, budou pokynu zákazníka v tabulce pokynů odpovídat dva řádky v tabulce obchodů, přičemž obchodník se na jednom řádku uvede jako investor ve vztahu k osobě se kterou uzavírá jako s protistranou obchod na vlastní účet, na druhém řádku se obchodník uvede jako protistrana k zákazníkovi, který je uveden v kolonce "IČ nebo RČ investora". Jeden řádek tedy poskytuje

Charakteristika:

informace o obchodu na vlastní účet obchodníka (protistranou je zde třetí osoba), druhý pak o obchodu (převodu) mezi obchodníkem a zákazníkem (protistranou je zde sám obchodník). Na pořadí řádků zde nezáleží, důležitá je správnost vyplněných časových údajů.

Pokud obchodník na základě zákaznickova pokynu provádí na trhu dílčí nákupy na vlastní účet (s cílem nakumulovat papíry a poté je jednorázově převést zákazníkovi), analogicky se zaznamená pokyn od zákazníka a k němu v tabulce obchodů všechny dílčí obchody, které budou mít shodnou položku "Číslo pokynu obchodu" s pokynem klienta, na jehož základě jsou dílčí pokyny realizovány. Způsob záznamu je tedy shodný jako v předcházejícím případě (tedy v případě služby obchodování na vlastní účet pro třetího), pouze v tabulce obchodů budou pod stejným číslem pokynu obchodu uvedena všechna dílčí plnění (každé na jiném řádku), tzn. obchod obchodníka s protistranou zde bude rozdělen na více plnění.

Existuje-li možnost dílčích nákupů přímo na účet zákazníka (analogie obchodu na cizí účet), bude k pokynu zákazníka existovat tolik záznamů v tabulce obchodů, kolik je dílčích plnění, nebude zde záznam o obchodu obchodníka s protistranou (osoba obchodníka zde nefiguruje).

Obdobně se postupuje v případě primární aukce či přijetí hromadných pokynů k exekuci, kde se použijí pravidla o zadávání hromadných pokynů.

V kolonce "Účet" bude hodnota "4"

Bude-li pokyn plněn zčásti "přes vlastní účet" a zčásti přímo (na cizí účet), tedy kombinací výše uvedených způsobů, použijí se analogicky oba způsoby záznamu a u plnění na cizí účet bude kolonce "Účet" hodnota "2".

5. Asset management, hromadné pokyny

V případě asset managementu se uvede jako zadavatel "pokynu" osoba obchodníka, která "pokyn" pro zákazníka zadává, a do položky investor se uvede zákazník, na jehož účet má být daný obchod realizován.

Připouští-li smlouva o obhospodařování zadávání pokynu zákazníkem, bude tabulka pokynů obsahovat údaje o tomto pokynu.

Pokud tuto možnost smlouva nepřipouští, pak obchodník vyplňuje údaje v tabulce pokynů v souladu s "pokynem", který dává oprávněná osoba osobě, pověřené realizací pokynu (makléři).

Pokyny v rámci asset managementu se zadávají jako obchody na cizí účet, osoba obchodníka se zde projeví pouze v poli zadavatel, v tabulce obchodů tedy bude jeden řádek.

Požizuje-li portfoliomanager investiční nástroje do portfolia zákazníka z vlastní pozice (nebo od zákazníka do vlastní pozice nakupuje), uvede se jako protistrana osoba obchodníka, eventuálně se postupuje jako v případě obchodu na vlastní účet pro třetího.

Jedná-li se o tzv. hromadné pokyny, postupuje se jako v případě obchodu na vlastní účet pro třetího. Hromadné pokyny se číslují v položce "Cislo pokynu obchodu" tak, že mají shodných prvních jedenáct znaků, poslední pětimístný identifikátor se čísluje vzestupně.. Obchodník zde má možnost vyplnit souhrnný hromadný pokyn s pětimístným identifikátorem 00000 a dílčí pokyny číslovat od 00001, nebo může souhrnný pokyn úplně vynechat a číslovat od 00001. Obchodník by se měl důsledně držet jedné z těchto variant..Pokud by v důsledku absence souhrnného hromadného pokynu nebylo možno uvést všechny

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_11

Charakteristika:

požadované informace (například nelze rozepsat poplatky na jednotlivé zákazníky a k dispozici je pouze souhrnný údaj), souhrnný hromadný pokyn musí být uveden.

Pokud za účelem plnění hromadného pokynu obchodník provádí dílčí nákupy do své pozice, bude postupovat, jakoby šlo o postupné plnění pokynu, tj. jednomu záznamu v tabulce pokynů (tento však dle první z výše uvedených variant nemusí být zaznamenán) bude odpovídat více záznamů v tabulce obchodů se shodným číslem a s koncovým identifikátorem 00000. Tabulka pokynů dále obsahuje všechny záznamy (řádky) týkající se zamýšlené distribuce na jednotlivé zákaznické účty, kde se uvedou všechny relevantní údaje (mj. množství nástrojů zamýšlená k distribuci a odměna obchodníka). V tabulce obchodů se vyskytne jednak obchod(y) na účet obchodníka s protistranou (protistranami) kde je obchodník investorem a jednak všechny obchody (převody) ve prospěch jednotlivých zákazníků, kde je obchodník protistranou. Jsou-li hromadné pokyny portfoliomanagera realizovány prostřednictvím jiného obchodníka, může (podle výše zvolené varianty) být v tabulce pokynů záznam o hromadném pokynu, kde bude investorem obchodník realizující pokyn (identifikátor 00000). Tento řádek nebude mít realizace v tabulce obchodů neboť portfoliomanager nemusí mít informace, za jakých podmínek pověřený obchodník pokyn realizoval. Pověřený obchodník pak bude protistranou vůči zákazníkům (investorům) v tabulce obchodů.

V kolonce "Účet" bude hodnota "3".

Obchodník, který přijímá hromadný pokyn od jiného obchodníka k nákupu a distribuci do portfolií zákazníků, postupuje jako v popsaném případě hromadného pokynu (na vlastní účet pro třetího). Zadavatelem zde bude obchodník- portfoliomanager. Vzhledem k tomu, že z pohledu přijímajícího obchodníka nejde o asset management, bude v kolonce "Účet" hodnota "4". Pravidla pro evidenci hromadných pokynů se vztahují též např. na primární aukce, kde obchodník na vlastní účet (např. v rámci syndikátu) nakoupí a poté provede distribuci mezi zákazníky. V kolonce "Účet" bude hodnota "4" a jednotlivé pokyny zákazníků je třeba v tabulce pokynů vyplnit.

Pokud by v rámci asset managementu zadával portfoliomanager pokyn pro primární aukci jinému obchodníkovi (makléři), postupuje se jako ve výše popsaném případě, kde jsou hromadné pokyny realizovány prostřednictvím jiného obchodníka, v kolonce "Účet" bude hodnota "3".

6. Repo obchody

Repa, B/S a půjčky se ve smyslu definice vedlejší investiční služby poskytování úvěrů považují buď za obchod na vlastní účet (nejdou-li uzavírat se zákazníkem), v kolonce "Účet" bude hodnota "1" a obchodník je investorem, nebo se považují za obchod na vlastní účet pro třetího, v kolonce "Účet" bude hodnota "4" a investorem bude zákazník.

Směr "první nohy" je dán hodnotou pole "Směr pokynu" v tabulce pokynů a vztahuje se vždy k položce "IČ nebo RČ investora". Tato zásada platí vždy a obchodník musí správně vyplnit položku "Směr pokynu" s ohledem na to, jestli je sám investorem, nebo jestli je investorem jiná osoba. V tabulce obchodů se u zpětného obchodu (druhé nohy) neuvádí identifikace osob, neboť z předcházejících údajů jsou tyto jednoznačně určeny.

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_11

Charakteristika:

7. (Custody) převody

V případě custody převodu se nevyplňují pole "IČ nebo RČ investora", "Pozadovany trh", "Účet" "Lhůta pokynu", "Makléř...", "Realizovany trh" případně další položky, které nejsou k dispozici či nemají pro daný převod význam. Zadavatelem se rozumí osoba zadávající pokyn ke custody převodu. Ostatní položky v tabulce pokynů se vztahují k instrukci k převodu. Protistranou se rozumí vypořádací agent. "Předání pokynu - datum" a "Předání pokynu - čas" jsou okamžik zadání pokynu k převodu ze strany obchodníka (obvykle swiftová zpráva), "Zobchodování - datum" a "Zobchodování - čas" je časový údaj uskutečnění obchodu jehož důsledkem je custody převod, "Vypořádání - sjednané datum" a "Vypořádání - konečné datum" jsou požadované a skutečné datумы převodu požadovaného nástroje.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0017	Číslo pokynu obchodu	an16
ECO0018	IČ nebo RČ zadavatele pokynu	an 30
ECO0019	IČ nebo RČ investora	an 30
ECO0020	Investiční instrument - ISIN	ISIN
ECO0021	Investiční instrument - název	an 30
ECO0022	Požadovaný trh	an 30
ECO0023	Typ transakce	an 1
ECO0024	Přijetí pokynu - datum	d3
ECO0025	Přijetí pokynu - čas	d7
ECO0026	Přijetí pokynu - způsob	an 1
ECO0027	Přijetí pokynu - místo	an 30
ECO0028	Požadovaný počet kusů	n11
ECO0029	Limitní objem	n11 2
ECO0030	Limitní cena	n11 2
ECO0031	Cena - jednotka	an 1
ECO0032	Cena - poznámka	an 30
ECO0033	Měna pokynu	an3
ECO0034	Směr pokynu	an 1
ECO0035	Lhůta platnosti pokynu	d3
ECO0036	Úplata OCP	n11 2
ECO0037	Úplata OCP - měna	an3
ECO0038	Stav pokynu	an 1
ECO0039	Makléř 1	an 30

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_11

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0040	Makléř 2	an 30
ECO0041	Makléř 3	an 30
ECO0042	Makléř 4	an 30

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0900	Pořadové číslo	Několik : n3_I1	Interval nad DT n3

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0517	Vazba na části deníku OCP	Položka : 01	Pokyny k obchodům s nástroji jinými než deriváty

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_11

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:
Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze: 1.0
Zdroj:

Stav: Platný
Garant: /

Platnost od: 01.01.2007

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_12

Název: Údaje o obchodech (inv. nástroje jiné než deriváty)

Charakteristika:

Datová oblast obsahující evidenci obchodů uskutečněných na základě přijatých pokynů, jejichž předmětem je nederivátový nástroj. Jednotlivé pokyny jsou jednoznačně určeny číslem pokynu.

Číslo pokynu obchodu je 16 místný textový údaj, jehož prvních 11 znaků tvoří jednoznačnou identifikaci pokynu, přijatého od zákazníka k obstarání investiční služby (k nákupu či prodeji investičního instrumentu). Zbylých 5 znaků slouží identifikaci hromadných pokynů. Nejde-li o hromadný pokyn (nebo obchod na základě hromadného pokynu), bude zde 5 nul, např. u OTC derivátů. Číslo pokynu se shoduje s čísly jednotlivých obchodů provedených na základě pokynu. Pokud bude pokyn od zákazníka uspokojován postupně (dílčími obchody), budou mít obchody na základě tohoto pokynu vždy shodných všech 16 znaků, čímž bude zajištěno jednoznačné přiřazení každého obchodu k pokynu, na jehož základě byl obchod uskutečněn. Sdružuje-li obchodník pokyny, budou mít jak sdružené pokyny, tak i vzniklý hromadný(é) pokyn(y) shodných prvních 11 znaků, zbylých 5 znaků bude číslováno od 00001 nebo od 00000. Typickým (ale ne výlučným) případem použití zde bude poskytování služeb v rámci "asset managementu", pokud portfoliomanager agreguje pokyny pro více zákazníků na základě stejné investiční strategie.

Pokud obchodník zprostředkovává obchod mezi svými dvěma zákazníky, zaznamená tento případ jako dva pokyny/obchody na cizí účet, pokaždé z pohledu jiného zákazníka a v kolonce "Účet" bude hodnota "2".

Položky "Předání pokynu - datum" a "Předání pokynu - čas" znamenají datum a čas zadání pokynu do obchodního systému regulovaného trhu, nebo v případě, že je pokyn předán třetí osobě k provedení, čas předání pokynu třetí straně, nebo čas jiného úkonu směřujícího k provedení pokynu. Účelem této položky je zachycení údaje o čase, kdy obchodník učinil první relevantní úkon k provedení pokynu.

"Zobchodování - datum" a "Zobchodování - čas" znamená čas uzavření obchodu na regulovaném trhu nebo dohody na podstatných náležitostech obchodu mimo regulovaný trh. V případě primárních aukcí se časem zobchodování rozumí čas vyhlášení výsledků aukce, eventuálně čas události rozhodné pro určení distribuovaného množství příslušného nástroje. Uzavřel-li obchodník obchod na regulovaném trhu a nemá-li obchodník tento údaj od regulovaného trhu k dispozici, položka se nevyplňuje.

Položka "Vypořádání - konečné datum" obsahuje obvykle stejnou hodnotu jako "Vypořádání - sjednané datum", pouze v případě, že obchod není řádně vypořádán, uvede se datum závěrečného dovypořádání.

Časové údaje se zadávají s přesností alespoň na minuty.

Obecné pokyny pro vyplňování výkazu:

V případě numerických položek, kdy je třeba vyjádřit skutečnost, že položka má nulovou hodnotu, musí být vyplněna nula, buňka nesmí zůstat prázdná (např. je-li výše úplaty související s obstaráním nákupu nulová, tuto skutečnost je nutno vyjádřit hodnotou nula). Buňka zůstane prázdná pouze v případech, kdy její vyplnění nedává smysl (např. "Podkladové

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_12

Charakteristika:

aktivum - spot rate" se nevyplní, není-li tato cena známa, neboť vyplnění nulou by poskytlo nepravdivou informaci).

V případě textových položek se buňky, jejichž vyplnění nedává smysl, nebo jejichž hodnotu nelze zjistit, vyplní hodnotou "N/A" (např. jméno u právnické osoby). Pokud by správnou hodnotou buňky byl prázdný řetězec, buňka se nevyplní.

Údaje o datumu a čase se oddělují do dvou položek, numerické vyjádření těchto položek je třeba přizpůsobit této okolnosti, tj. datový údaj musí být oddělen od desetinné části určující konkrétní časový údaj. Není-li datum známo, položka zůstane nevyplněna.

Vyplňované hodnoty se zaokrouhlují na v praxi používaný počet desetinných míst.

Datový soubor je rozdělen do několika datových oblastí, přičemž v obou tabulkách pokynů musí být číslo pokynu unikátní, tzn. nesmí se v dané tabulce opakovat, musí mu náležet právě jeden pokyn (a nesmí zůstat nevyplněné). V tabulkách obchodů se naopak vícenásobný výskyt předpokládá, a to u obchodů, které se váží na jeden pokyn (např. operace typu repo, kde k pokynu stačí jeden řádek).

Datový formulář byl vytvořen s maximálním ohledem na stávající způsob (formát) zasílání dat Burze cenných papírů. Přestože je rozsah deníku obchodníka mnohem rozsáhlejší, vyskytuje se zde dost společných položek. U některých však bylo třeba upravit způsob vyplňování kódů, eventuálně upravit jejich délku. Před odesláním souboru je v zájmu obchodníka, aby si překontroloval nejen správnost použitých kódů či zkratk, ale i správnost formátu a délky položek.

Dalšími kontrolovanými údaji jsou datumové a časové položky. U pokynů a obchodů týkajících se nederivátových nástrojů jsou kontrolovány následující časové posloupnosti :

pokyny:

datum a čas přijetí pokynu $\leq$ lhůta platnosti pokynu

obchody :

datum zobchodování $\leq$ datum sjednaného vypořádání

pro transakce typu "D" navíc datum a čas přijetí pokynu $\leq$ datum a čas předání pokynu $\leq$ datum a čas zobchodování a

datum sjednaného vypořádání $\leq$ datum konečného vypořádání

Testuje se rovněž vyplnění identifikace investora v datové oblasti "Údaje o pokynech (inv. nástroje jiné než deriváty)" u typů transakce jiných než "C" a "J" a vyplnění identifikace investora a protistrany v datové oblasti "Údaje o obchodech (inv. nástroje jiné než deriváty)" u typu transakce "D" (zejména u rep nemusí být vyplněno).

Charakteristika:

Způsob záznamu pokynů/obchodů s nederiváty

1. Nerealizovaný obchod

V případě, že na základě pokynu nebyl uzavřen obchod, nevyplňuje se již tabulka obchodů.

2. Obchod na vlastní účet obchodníka

V případě, že se jedná o obchod na vlastní účet obchodníka, který není investiční službou, postupuje se jakoby osoba zadávající "pokyn" k obchodu na vlastní účet byla obchodník. Obchodník vyplní v tabulce pokynů údaje o přijetí pokynu jako "Požadovaný počet kusů", "Limitní objem", "Limitní cena", "Měna pokynu", "Lhůta platnosti pokynu" apod. ... a časové údaje. Tyto údaje představují interní pokyn oprávněné osoby k uzavírání obchodů na vlastní účet obchodníka osobě realizující tento pokyn (makléři). V tabulce obchodů vyplní jeden řádek, který bude mít shodné "Číslo pokynu obchodu". V kolonce "Účet" bude hodnota "1" a obchodník zde bude "zadavatelem" i "investorem". Plní-li však takto obchodník pokyn zákazníka z vlastní pozice, tabulka pokynů obsahuje údaje o tomto pokynu zákazníka.

3. Obchod na cizí účet

V případě obchodu na cizí účet vyplní obchodník příslušná pole v tabulce pokynů a jeden odpovídající řádek v tabulce obchodů. Osoba obchodníka zde nefiguruje. Sem bude spadat i případ prodeje a zpětného nákupu podílových listů, pokud tak obchodník činí na účet investiční společnosti, tato zde bude protistranou. V kolonce "Účet" bude hodnota "2".

4. Obchod na vlastní účet pro třetího

V případě, že obchodník kupuje od zákazníka investiční nástroj či prodává zákazníkovi investiční nástroj ze svého účtu-tj. jako službu na vlastní účet pro třetího dle § 4 odst. 2 písm. c) zákona č. 256/2004 Sb., ve znění pozdějších předpisů, budou pokynu zákazníka v tabulce pokynů odpovídat dva řádky v tabulce obchodů, přičemž obchodník se na jednom řádku uvede jako investor ve vztahu k osobě se kterou uzavírá jako s protistranou obchod na vlastní účet, na druhém řádku se obchodník uvede jako protistrana k zákazníkovi, který je uveden v kolonce "IČ nebo RČ investora". Jeden řádek tedy poskytuje informace o obchodu na vlastní účet obchodníka (protistranou je zde třetí osoba), druhý pak o obchodu (převodu) mezi obchodníkem a zákazníkem (protistranou je zde sám obchodník). Na pořadí řádků zde nezáleží, důležitá je správnost vyplněných časových údajů.

Pokud obchodník na základě zákaznickova pokynu provádí na trhu dílčí nákupy na vlastní účet (s cílem nakumulovat papíry a poté je jednorázově převést zákazníkovi), analogicky se zaznamená pokyn od zákazníka a k němu v tabulce obchodů všechny

Charakteristika:

dílčí obchody, které budou mít shodnou položku "Číslo pokynu obchodu" s pokynem klienta, na jehož základě jsou dílčí pokyny realizovány. Způsob záznamu je tedy shodný jako v předcházejícím případě (tedy v případě služby obchodování na vlastní účet pro třetího), pouze v tabulce obchodů budou pod stejným číslem pokynu obchodu uvedena všechna dílčí plnění (každé na jiném řádku), tzn. obchod obchodníka s protistranou zde bude rozdělen na více plnění. Existuje-li možnost dílčích nákupů přímo na účet zákazníka (analogie obchodu na cizí účet), bude k pokynu zákazníka existovat tolik záznamů v tabulce obchodů, kolik je dílčích plnění, nebude zde záznam o obchodu obchodníka s protistranou (osoba obchodníka zde nefiguruje). Obdobně se postupuje v případě primární aukce či přijetí hromadných pokynů k exekuci, kde se použijí pravidla o zadávání hromadných pokynů. V kolonce "Účet" bude hodnota "4". Bude-li pokyn plněn zčásti "přes vlastní účet" a zčásti přímo (na cizí účet), tedy kombinací výše uvedených způsobů, použijí se analogicky oba způsoby záznamu a u plnění na cizí účet bude kolonce "Účet" hodnota "2".

5. Asset management, hromadné pokyny

V případě asset managementu se uvede jako zadavatel "pokynu" osoba obchodníka, která "pokyn" pro zákazníka zadává, a do položky investor se uvede zákazník, na jehož účet má být daný obchod realizován. Připouští-li smlouva o obhospodařování zadávání pokynu zákazníkem, bude tabulka pokynů obsahovat údaje o tomto pokynu. Pokud tuto možnost smlouva nepřipouští, pak obchodník vyplňuje údaje v tabulce pokynů v souladu s "pokynem", který dává oprávněná osoba osobě, pověřené realizací pokynu (makléři). Pokyny v rámci asset managementu se zadávají jako obchody na cizí účet, osoba obchodníka se zde projeví pouze v poli zadavatel, v tabulce obchodů tedy bude jeden řádek. Pořizuje-li portfoliomanager investiční nástroje do portfolia zákazníka z vlastní pozice (nebo od zákazníka do vlastní pozice nakupuje), uvede se jako protistrana osoba obchodníka, eventuálně se postupuje jako v případě obchodu na vlastní účet pro třetího. Jedná-li se o tzv. hromadné pokyny, postupuje se jako v případě obchodu na vlastní účet pro třetího. Hromadné pokyny se číslují v položce "Číslo pokynu obchodu" tak, že mají shodných prvních jedenáct znaků, poslední pětimístný identifikátor se čísluje vzestupně.. Obchodník zde má možnost vyplnit souhrnný hromadný pokyn s pětimístným identifikátorem 00000 a dílčí pokyny číslovat od 00001, nebo může souhrnný pokyn úplně vynechat a číslovat od 00001. Obchodník by se měl důsledně držet jedné z těchto variant.. Pokud by v důsledku absence souhrnného hromadného pokynu nebylo možno uvést všechny požadované informace (například nelze rozepsat poplatky na jednotlivé zákazníky a k dispozici je pouze souhrnný údaj), souhrnný hromadný pokyn musí být uveden.

Pokud za účelem plnění hromadného pokynu obchodník provádí dílčí nákupy do své pozice, bude postupovat, jakoby šlo o postupné plnění pokynu, tj. jednomu záznamu v tabulce pokynů (tento však dle první z výše uvedených variant nemusí být

Charakteristika:

zaznamenán) bude odpovídat více záznamů v tabulce obchodů se shodným číslem a s koncovým identifikátorem 00000. Tabulka pokynů dále obsahuje všechny záznamy (řádky) týkající se zamýšlené distribuce na jednotlivé zákaznické účty, kde se uvedou všechny relevantní údaje (mj. množství nástrojů zamýšlená k distribuci a odměna obchodníka). V tabulce obchodů se vyskytne jednak obchod(y) na účet obchodníka s protistranou (protistranami) kde je obchodník investorem a jednak všechny obchody (převody) ve prospěch jednotlivých zákazníků, kde je obchodník protistranou. Jsou-li hromadné pokyny portfoliomanagera realizovány prostřednictvím jiného obchodníka, může (podle výše zvolené varianty) být v tabulce pokynů záznam o hromadném pokynu, kde bude investorem obchodník realizující pokyn (identifikátor 00000). Tento řádek nebude mít realizace v tabulce obchodů neboť portfoliomanager nemusí mít informace, za jakých podmínek pověřený obchodník pokyn realizoval. Pověřený obchodník pak bude protistranou vůči zákazníkům (investorům) v tabulce obchodů.

V kolonce "Účet" bude hodnota "3".

Obchodník, který přijímá hromadný pokyn od jiného obchodníka k nákupu a distribuci do portfolií zákazníků, postupuje jako v popsaném případě hromadného pokynu (na vlastní účet pro třetího). Zadavatelem zde bude obchodník- portfoliomanager. Vzhledem k tomu, že z pohledu přijímajícího obchodníka nejde o asset management, bude v kolonce "Účet" hodnota "4". Pravidla pro evidenci hromadných pokynů se vztahují též např. na primární aukce, kde obchodník na vlastní účet (např. v rámci syndikátu) nakoupí a poté provede distribuci mezi zákazníky. V kolonce "Účet" bude hodnota "4" a jednotlivé pokyny zákazníků je třeba v tabulce pokynů vyplnit.

Pokud by v rámci asset managementu zadával portfoliomanager pokyn pro primární aukci jinému obchodníkovi (makléři), postupuje se jako ve výše popsaném případě, kde jsou hromadné pokyny realizovány prostřednictvím jiného obchodníka, v kolonce "Účet" bude hodnota "3".

6. Repo obchody

Repa, B/S a půjčky se ve smyslu definice vedlejší investiční služby poskytování úvěrů považují buď za obchod na vlastní účet (nejdou-li uzavírat se zákazníkem), v kolonce "Účet" bude hodnota "1" a obchodník je investorem, nebo se považují za obchod na vlastní účet pro třetího, v kolonce "Účet" bude hodnota "4" a investorem bude zákazník.

Směr "první nohy" je dán hodnotou pole "Směr pokynu" v tabulce pokynů a vztahuje se vždy k položce "IČ nebo RČ investora". Tato zásada platí vždy a obchodník musí správně vyplnit položku "Směr pokynu" s ohledem na to, jestli je sám investorem, nebo jestli je investorem jiná osoba. V tabulce obchodů se u zpětného obchodu (druhé nohy) neuvádí identifikace osob, neboť z předcházejících údajů jsou tyto jednoznačně určeny.

7. (Custody) převody

V případě custody převodu se nevyplňují pole "IČ nebo RČ investora", "Pozadovaný trh", "Účet" "Lhůta pokynu", "Makléř...", "Realizovaný trh" případně další položky, které nejsou k dispozici či nemají pro daný převod význam. Zadavatelem se rozumí

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_12

Charakteristika:

osoba zadávající pokyn ke custody převodu. Ostatní položky v tabulce pokynů se vztahují k instrukci k převodu. Protistranou se rozumí vypořádací agent. "Předání pokynu - datum" a "Předání pokynu - čas" jsou okamžik zadání pokynu k převodu ze strany obchodníka (obvykle swiftová zpráva), "Zobchodování - datum" a "Zobchodování - čas" je časový údaj uskutečnění obchodu jehož důsledkem je custody převod, "Vypořádání - sjednané datum" a "Vypořádání - konečné datum" jsou požadované a skutečné datумы převodu požadovaného nástroje.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0017	Číslo pokynu obchodu	an16
ECO0019	IČ nebo RČ investora	an 30
ECO0043	Interčíslo trhu	an 35
ECO0044	Realizovaný trh	an 30
ECO0045	IČ nebo RČ protistrany	an 30
ECO0046	Účet	an 1
ECO0047	Zobchodovaný nebo převedený počet kusů	n11
ECO0048	Realizovaná cena	n11 2
ECO0049	Měna - obchod	an3
ECO0050	Měna - zdroj	an3
ECO0051	Měna - kurz	n11 2
ECO0052	Předání pokynu - datum	d3
ECO0053	Předání pokynu - čas	d7
ECO0054	Zobchodování - datum	d3
ECO0055	Zobchodování - čas	d7
ECO0056	Vypořádání - sjednané datum	d3
ECO0057	Vypořádání - konečné datum	d3
ECO0058	Úplata třetí osoby	n11 2
ECO0059	Úplata třetí osoby - měna	an3

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0900	Pořadové číslo	Několik : n3_I1	Interval nad DT n3

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_12

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0517	Vazba na části deníku OCP	Položka : 02	Uskutečněné obchody s nástroji jinými než deriváty

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_12

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Stav:Platný

Platnost od:01.01.2007

Zdroj:

Garant: /

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_21

Název: Údaje o pokynech (deriváty)

Charakteristika:

Datová oblast obsahující evidenci pokynů k uskutečnění obchodu, jejichž předmětem je derivátový nástroj. Jednotlivé pokyny jsou jednoznačně určeny číslem pokynu.

Číslo pokynu obchodu je 16 místný textový údaj, jehož prvních 11 znaků tvoří jednoznačnou identifikaci pokynu, přijatého od zákazníka k obstarání investiční služby (k nákupu či prodeji investičního instrumentu). Zbylých 5 znaků slouží identifikaci hromadných pokynů. Nejde-li o hromadný pokyn (nebo obchod na základě hromadného pokynu), bude zde 5 nul, např. u OTC derivátů. Číslo pokynu se shoduje s čísly jednotlivých obchodů provedených na základě pokynu. Pokud bude pokyn od zákazníka uspokojován postupně (dílčími obchody), budou mít obchody na základě tohoto pokynu vždy shodných všech 16 znaků, čímž bude zajištěno jednoznačné přiřazení každého obchodu k pokynu, na jehož základě byl obchod uskutečněn. Sdružuje-li obchodník pokyny, budou mít jak sdružené pokyny, tak i vzniklý hromadný(é) pokyn(y) shodných prvních 11 znaků, zbylých 5 znaků bude číslováno od 00001 nebo od 00000. Typickým (ale ne výlučným) případem použití zde bude poskytování služeb v rámci "asset managementu", pokud portfoliomanager agreguje pokyny pro více zákazníků na základě stejné investiční strategie.

Pokud obchodník zprostředkovává obchod mezi svými dvěma zákazníky, zaznamená tento případ jako dva pokyny/obchody na cizí účet, pokaždé z pohledu jiného zákazníka.

Změny pokynů se zanáší jako zrušení původního pokynu (vyplní se odpovídající hodnota v položce "Stav") a zadání pokynu nového.

Položky "Přijetí pokynu - datum", "Přijetí pokynu - čas" znamenají okamžik, kdy se pokyn dostal do dispoziční sféry obchodníka (přijetí faxu, elektronické zprávy obsahující pokyn, vyplnění údajů při osobním podání pokynu apod.). V případě interního pokynu jde o okamžik předání pokynu osobou oprávněnou osobě pokyn realizující (makléři). Položka "Přijetí pokynu - datum" je rozhodující pro určení, které záznamy budou zahrnuty do výkazu pro příslušné období a proto musí být vyplněna vždy, ve výjimečných případech, kdy se údaje o pokynu nevyplňují se zde uvede údaj položky "Předání pokynu - datum". Lhůtou pokynu se rozumí poslední den platnosti pokynu. Časové údaje se zadávají s přesností alespoň na minuty.

V položkách "Makléř..." se uvádí příjmení všech makléřů, kteří prováděli odborné obchodní činnosti související s obchodem podle vyhlášky č 259/2004 Sb., o druzích odborných obchodních činností obchodníka s cennými papíry vykonávaných prostřednictvím makléře, o druzích odborné specializace makléře a o makléřské zkoušce, ve znění pozdějších předpisů. Například v případě asset managementu (vlastní realizace) bude uvedeno minimálně příjmení portfoliomanagera zadávajícího pokyn a jméno makléře, který prováděl odborné obchodní činnosti v souvislosti s plněním pokynu.

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_21

Charakteristika:

Obecné pokyny pro vyplňování výkazu:

V případě numerických položek, kdy je třeba vyjádřit skutečnost, že položka má nulovou hodnotu, musí být vyplněna nula, buňka nesmí zůstat prázdná (např. je-li výše úplaty související s obstaráním nákupu nulová, tuto skutečnost je nutno vyjádřit hodnotou nula). Buňka zůstane prázdná pouze v případech, kdy její vyplnění nedává smysl (např. "Podkladové aktivum - spot rate" se nevyplní, není-li tato cena známa, neboť vyplnění nulou by poskytlo nepravdivou informaci).

V případě textových položek se buňky, jejichž vyplnění nedává smysl, nebo jejichž hodnotu nelze zjistit, vyplní hodnotou "N/A" (např. jméno u právnické osoby). Pokud by správnou hodnotou buňky byl prázdný řetězec, buňka se nevyplní.

Údaje o datumu a čase se oddělují do dvou položek, numerické vyjádření těchto položek je třeba přizpůsobit této okolnosti, tj. datový údaj musí být oddělen od desetinné části určující konkrétní časový údaj. Není-li datum známo, položka zůstane nevyplněna.

Vyplňované hodnoty se zaokrouhlují na v praxi používaný počet desetinných míst.

Datový formulář je rozdělen do několika datových oblastí, přičemž v obou tabulkách pokynů musí být číslo pokynu unikátní, tzn. nesmí se v dané tabulce opakovat, musí mu náležet právě jeden pokyn (a nesmí zůstat nevyplněné). V tabulkách obchodů se naopak vícenásobný výskyt předpokládá, a to u obchodů, které se váží na jeden pokyn (např. operace typu repo, kde k pokynu stačí jeden řádek).

Identifikační číslo, resp. rodné číslo, v tabulce osob musí být taktéž unikátní a musí být vždy vyplněno. Tabulka osob musí obsahovat úplný seznam osob, které ve vykazovaných pokynech a obchodech za hlášené období vystupují jako zadavatel, investor nebo protistrana.

Datový formulář byl vytvořen s maximálním ohledem na stávající způsob (formát) zasílání dat Burze cenných papírů. Přestože je rozsah deníku obchodníka mnohem rozsáhlejší, vyskytuje se zde dost společných položek. U některých však bylo třeba upravit způsob vyplňování kódů, eventuálně upravit jejich délku. Před odesláním souboru je v zájmu obchodníka, aby si překontroloval nejen správnost použitých kódů či zkratk, ale i správnost formátu a délky položek.

Dalšími kontrolovanými údaji jsou datumové a časové položky. Kontrolovány jsou následující časové posloupnosti :

pokyny:

datum a čas přijetí pokynu <= lhůta platnosti pokynu

obchody:

Charakteristika:

datum a čas přijetí pokynu <= datum a čas předání pokynu <= datum a čas zobchodování
datum zobchodování <= datum sjednaného vypořádání <= datum konečného vypořádání

Pokyny a obchody se standardizovanými deriváty obchodovanými na regulovaném trhu

Deriváty obchodované na regulovaných trzích se až na drobná specifika evidují stejným způsobem, jako nederiváty a přiměřeně se na ně aplikují i výše uvedené způsoby záznamu.

"Směr pokynu" může nabývat následujících hodnot: "1" = Nákup nebo jiné nabytí investičního nástroje, "2" = Prodej nebo jiné zcizení investičního nástroje, "3" = Nákup za účelem uzavírání pozice, "4" = Prodej za účelem otevírání pozice. Kódy "3" a "4" se aplikují v případě, kdy jsou zadávány do obchodního systému organizátora veřejného trhu.

Vzhledem k široké paletě derivátů je obchodníkovi ponechána určitá volnost v označení derivátu, k tomuto účelu slouží čtyři pole:

"Derivát - ID" slouží především obchodníkovi, aby měl možnost použít označení, které používá jeho informační systém a měl tedy i zpětnou kontrolu nad záznamy, eventuálně zde může být značení používané veřejným trhem či jiné obdobné označení.

Položkou "Derivát - název" se rozumí název, používaný na příslušném organizovaném trhu,

"Derivát - ticker" je kód derivátu používaný v systému organizátora veřejného trhu, v odůvodněných případech lze použít symbolů zavedených v analytických a informačních systémech.

"Derivát - typ, druh" znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, jako např. "BUY-Option",

"Futures" atp. Toto označení a položka "Derivát - ticker" jsou povinné, z ostatních položek obchodník vybere co lze vhodně aplikovat. Nevyužitá pole zůstanou volná.

U všech derivátů je třeba specifikovat jejich základní charakteristiky, mezi které patří množství podkladového aktiva na jednotku kontraktu (velikost kontraktu, "Podkladové aktivum - množství") event. jeho nominální hodnota, identifikace podkladového aktiva identifikačním číslem investičního nástroje podle mezinárodního systému číslování pro identifikaci investičních nástrojů, je-li přiděleno, nebo kód používaný obchodníkem pro toto aktivum ("Podkladové aktivum - ID"). Dále sem patří název podkladového aktiva, eventuálně kód měny (dle ISO4217), je-li podkladovým aktivem měna, eventuálně jiná výstižná specifikace podkladového aktiva ("Podkladové aktivum - název").

U opcí se uvede cena, za kterou může být nakoupeno podkladové aktivum v případě, že bude uplatněno právo vyplývající z derivátu (realizační cena), u futures termínová cena (kurz, sazba) podkladového aktiva ("Podkl aktivum Fw Strike Rate"). Platností ("Platnost Maturita") se rozumí datum expirace nebo datum prekluze práv z derivátu, u opčních kontraktů se jedná o termín vypršení opce, jinak se jedná o termín ukončení platnosti kontraktu.

Položka "Účet" zde má stejný význam jako u nederivátových obchodů neboť se i zde předpokládá výkon investičních služeb a tudíž, jedná li se o obchod se zákazníkem, budou vyplněny i příslušné údaje o pokynu. Způsob evidence je analogický jako u nederivátových pokynů.

Položka "IČ/RČ protistrany" se vyplňuje analogicky jako u nederivátů, v případech, kdy by se jednalo o organizátora trhu

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_21

Charakteristika:

se nechává volné, pokud je organizátor specifikován v poli "Požadovaný trh".

Pro časové údaje se použijí přiměřeně pravidla nederivátové části.

Samotná expirace opce se neneviduje, exekuce opce, je-li podkladovým aktivem investiční nástroj, se zanáší do nederivátové části výkazu.

Pokyn je obdobně jako u nederivátů specifikován cenou nebo objemem, tento údaj se vztahuje k jednomu kontraktu. Je-li cenová dispozice dána pouze jedním cenovým údajem, vyplní se v položce "Cena 1", pro další cenový údaj se použije položka "Cena 2".

Označování derivátů

Položka "Derivát - typ, druh" je vždy povinná a je klíčová pro základní rozdělení derivátů. Znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, přičemž z označení nemusí vyplývat žádný údaj o podkladovém aktivu, tyto informace jsou obsaženy v dalších položkách. Předpokládá se následující označení nejběžnějších derivátů:

FX Forward
FX-Swap
BUY-Option
SELL-Option
FRA
IRS FIX/FLOAT 6M
CC IRS
Forward Akcie
Forward Bond
Futures

Jedná-li se o složitější konstrukce, zejména OTC produkty na bázi opcí, jako např. caps, floors, options atp, používají se pro označení vžitá event. výstižná názvy.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0017	Číslo pokynu obchodu	an16
ECO0018	IČ nebo RČ zadavatele pokynu	an 30
ECO0019	IČ nebo RČ investora	an 30

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_21

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0022	Požadovaný trh	an 30
ECO0024	Přijetí pokynu - datum	d3
ECO0025	Přijetí pokynu - čas	d7
ECO0026	Přijetí pokynu - způsob	an 1
ECO0027	Přijetí pokynu - místo	an 30
ECO0028	Požadovaný počet kusů	n11
ECO0029	Limitní objem	n11 2
ECO0031	Cena - jednotka	an 1
ECO0032	Cena - poznámka	an 30
ECO0033	Měna pokynu	an3
ECO0034	Směr pokynu	an 1
ECO0035	Lhůta platnosti pokynu	d3
ECO0036	Úplata OCP	n11 2
ECO0037	Úplata OCP - měna	an3
ECO0038	Stav pokynu	an 1
ECO0039	Makléř 1	an 30
ECO0040	Makléř 2	an 30
ECO0041	Makléř 3	an 30
ECO0042	Makléř 4	an 30
ECO0060	Derivát - ID	an 30
ECO0061	Derivát - název	an 30
ECO0062	Derivát - ticker	an 30
ECO0063	Derivát - typ, druh	an 30
ECO0064	Podkladové aktivum - ID	an 30
ECO0065	Podkladové aktivum - název	an 30
ECO0066	Podkladové aktivum - množství	n11 2
ECO0067	Podkladové aktivum - forward strike rate	n11 2
ECO0068	Platnost, maturita	d3
ECO0069	Vysvětlivka	an80
ECO0070	Cena 1	n11 2
ECO0071	Cena 2	n11 2

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_21

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0900	Pořadové číslo	Několik : n3_I1	Interval nad DT n3

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0517	Vazba na části deníku OCP	Položka : 03	Pokyny k obchodům s veřejně obchodovanými deriváty

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_21

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze:1.0

Stav:Platný

Platnost od:01.01.2007

Zdroj:

Garant: /

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_22

Název: Údaje o obchodech (deriváty)

Charakteristika:

Datová oblast obsahující evidenci obchodů uskutečněných na základě přijatých pokynů, jejichž předmětem je derivátový nástroj. Jednotlivé pokyny jsou jednoznačně určeny číslem pokynu.

Číslo pokynu obchodu je 16 místný textový údaj, jehož prvních 11 znaků tvoří jednoznačnou identifikaci pokynu, přijatého od zákazníka k obstarání investiční služby (k nákupu či prodeji investičního instrumentu). Zbylých 5 znaků slouží identifikaci hromadných pokynů. Nejde-li o hromadný pokyn (nebo obchod na základě hromadného pokynu), bude zde 5 nul, např. u OTC derivátů. Číslo pokynu se shoduje s čísly jednotlivých obchodů provedených na základě pokynu. Pokud bude pokyn od zákazníka uspokojován postupně (dílčími obchody), budou mít obchody na základě tohoto pokynu vždy shodných všech 16 znaků, čímž bude zajištěno jednoznačné přiřazení každého obchodu k pokynu, na jehož základě byl obchod uskutečněn. Sdružuje-li obchodník pokyny, budou mít jak sdružené pokyny, tak i vzniklý hromadný(é) pokyn(y) shodných prvních 11 znaků, zbylých 5 znaků bude číslováno od 00001 nebo od 00000. Typickým (ale ne výlučným) případem použití zde bude poskytování služeb v rámci "asset managementu", pokud portfoliomanager agreguje pokyny pro více zákazníků na základě stejné investiční strategie.

Pokud obchodník zprostředkovává obchod mezi svými dvěma zákazníky, zaznamená tento případ jako dva pokyny/obchody na cizí účet, pokaždé z pohledu jiného zákazníka a v kolonce "Účet" bude hodnota "2".

Položky "Předání pokynu - datum" a "Předání pokynu - čas" znamenají datum a čas zadání pokynu do obchodního systému regulovaného trhu, nebo v případě, že je pokyn předán třetí osobě k provedení, čas předání pokynu třetí straně, nebo čas jiného úkonu směřujícího k provedení pokynu. Účelem této položky je zachycení údaje o čase, kdy obchodník učinil první relevantní úkon k provedení pokynu.

"Zobchodování - datum" a "Zobchodování - čas" znamená čas uzavření obchodu na regulovaném trhu nebo dohody na podstatných náležitostech obchodu mimo regulovaný trh. V případě primárních aukcí se časem zobchodování rozumí čas vyhlášení výsledků aukce, eventuálně čas události rozhodné pro určení distribuovaného množství příslušného nástroje. Uzavřel-li obchodník obchod na regulovaném trhu a nemá-li obchodník tento údaj od regulovaného trhu k dispozici, položka se nevyplňuje.

Položka "Vypořádání - konečné datum" obsahuje obvykle stejnou hodnotu jako "Vypořádání - sjednané datum", pouze v případě, že obchod není řádně vypořádán, uvede se datum závěrečného dovypořádání.

Časové údaje se zadávají s přesností alespoň na minuty.

Obecné pokyny pro vyplňování výkazu:

V případě numerických položek, kdy je třeba vyjádřit skutečnost, že položka má nulovou hodnotu, musí být vyplněna nula, buňka nesmí zůstat prázdná (např. je-li výše úplaty související s obstaráním nákupu nulová, tuto skutečnost je nutno vyjádřit hodnotou nula). Buňka zůstane prázdná pouze v případech, kdy její vyplnění nedává smysl (např. "Podkladové

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_22

Charakteristika:

aktivum - spot rate" se nevyplní, není-li tato cena známa, neboť vyplnění nulou by poskytlo nepravdivou informaci).

V případě textových položek se buňky, jejichž vyplnění nedává smysl, nebo jejichž hodnotu nelze zjistit, vyplní hodnotou "N/A" (např. jméno u právnické osoby). Pokud by správnou hodnotou buňky byl prázdný řetězec, buňka se nevyplní.

Údaje o datumu a čase se oddělují do dvou položek, numerické vyjádření těchto položek je třeba přizpůsobit této okolnosti, tj. datový údaj musí být oddělen od desetinné části určující konkrétní časový údaj. Není-li datum známo, položka zůstane nevyplněna.

Vyplňované hodnoty se zaokrouhlují na v praxi používaný počet desetinných míst.

Datový formulář je rozdělen do několika datových oblastí, přičemž v obou tabulkách pokynů musí být číslo pokynu unikátní, tzn. nesmí se v dané tabulce opakovat, musí mu náležet právě jeden pokyn (a nesmí zůstat nevyplněné). V tabulkách obchodů se naopak vícenásobný výskyt předpokládá, a to u obchodů, které se váží na jeden pokyn (např. operace typu repo, kde k pokynu stačí jeden řádek).

Identifikační číslo, resp. rodné číslo, v tabulce osob musí být taktéž unikátní a musí být vždy vyplněno. Tabulka osob musí obsahovat úplný seznam osob, které ve vykazovaných pokynech a obchodech za hlášené období vystupují jako zadavatel, investor nebo protistrana.

Datový formulář byl vytvořen s maximálním ohledem na stávající způsob (formát) zasílání dat Burze cenných papírů. Přestože je rozsah deníku obchodníka mnohem rozsáhlejší, vyskytuje se zde dost společných položek. U některých však bylo třeba upravit způsob vyplňování kódů, eventuálně upravit jejich délku. Před odesláním souboru je v zájmu obchodníka, aby si překontroloval nejen správnost použitých kódů či zkratk, ale i správnost formátu a délky položek.

Dalšími kontrolovanými údaji jsou datumové a časové položky. Kontrolovány jsou následující časové posloupnosti :

pokyny:

datum a čas přijetí pokynu <= lhůta platnosti pokynu

obchody:

datum a čas přijetí pokynu <= datum a čas předání pokynu <= datum a čas zobchodování

datum zobchodování <= datum sjednaného vypořádání <= datum konečného vypořádání

Pokyny a obchody se standardizovanými deriváty obchodovanými na regulovaném trhu

Charakteristika:

Deriváty obchodované na regulovaných trzích se až na drobná specifika evidují stejným způsobem, jako nederiváty a přiměřeně se na ně aplikují i výše uvedené způsoby záznamu.

"Směr pokynu" může nabývat následujících hodnot: "1" = Nákup nebo jiné nabytí investičního nástroje, "2" = Prodej nebo jiné zcizení investičního nástroje, "3" = Nákup za účelem uzavírání pozice, "4" = Prodej za účelem otevírání pozice. Kódy "3" a "4" se aplikují v případě, kdy jsou zadávány do obchodního systému organizátora veřejného trhu.

Vzhledem k široké paletě derivátů je obchodníkovi ponechána určitá volnost v označení derivátu, k tomuto účelu slouží čtyři pole:

"Derivát - ID" slouží především obchodníkovi, aby měl možnost použít označení, které používá jeho informační systém a měl tedy i zpětnou kontrolu nad záznamy, eventuelně zde může být značení používané veřejným trhem či jiné obdobné označení.

Položkou "Derivát - název" se rozumí název, používaný na příslušném organizovaném trhu,

"Derivát - ticker" je kód derivátu používaný v systému organizátora veřejného trhu, v odůvodněných případech lze použít symbolů zavedených v analytických a informačních systémech.

"Derivát - typ, druh" znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, jako např. "BUY-Option",

"Futures" atp. Toto označení a položka "Derivát - ticker" jsou povinné, z ostatních položek obchodník vybere co lze vhodně aplikovat. Nevyužitá pole zůstanou volná.

U všech derivátů je třeba specifikovat jejich základní charakteristiky, mezi které patří množství podkladového aktiva na jednotku kontraktu (velikost kontraktu, "Podkladové aktivum - množství") event. jeho nominální hodnota, identifikace podkladového aktiva identifikačním číslem investičního nástroje podle mezinárodního systému číslování pro identifikaci investičních nástrojů, je-li přiděleno, nebo kód používaný obchodníkem pro toto aktivum ("Podkladové aktivum - ID"). Dále sem patří název podkladového aktiva, eventuelně kód měny (dle ISO4217), je-li podkladovým aktivem měna, eventuelně jiná výstižná specifikace podkladového aktiva ("Podkladové aktivum - název").

U opcí se uvede cena, za kterou může být nakoupeno podkladové aktivum v případě, že bude uplatněno právo vyplývající z derivátu (realizační cena), u futures termínová cena (kurz, sazba) podkladového aktiva ("Podkl aktivum Fw Strike Rate"). Platností ("Platnost Maturita") se rozumí datum expirace nebo datum prekluze práv z derivátu, u opčních kontraktů se jedná o termín vypršení opce, jinak se jedná o termín ukončení platnosti kontraktu.

Položka "Účet" zde má stejný význam jako u nederivátových obchodů neboť se i zde předpokládá výkon investičních služeb a tudíž, jedná li se o obchod se zákazníkem, budou vyplněny i příslušné údaje o pokynu. Způsob evidence je analogický jako u nederivátových pokynů.

Položka "IČ/RČ protistrany" se vyplňuje analogicky jako u nederivátů, v případech, kdy by se jednalo o organizátora trhu se nechává volné, pokud je organizátor specifikován v poli "Požadovaný trh".

Pro časové údaje se použijí přiměřeně pravidla nederivátové části.

Samotná expirace opce se neeviduje, exekuce opce, je-li podkladovým aktivem investiční nástroj, se zanáší do nederivátové části výkazu.

Pokyn je obdobně jako u nederivátů specifikován cenou nebo objemem, tento údaj se vztahuje k jednomu kontraktu. Je-li cenová dispozice dána pouze jedním cenovým údajem, vyplní se v položce "Cena 1", pro další cenový údaj se použije položka

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_22

Charakteristika:

"Cena 2".

Označování derivátů

Položka "Derivát - typ, druh" je vždy povinná a je klíčová pro základní rozdělení derivátů. Znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, přičemž z označení nemusí vyplývat žádný údaj o podkladovém aktivu, tyto informace jsou obsaženy v dalších položkách. Předpokládá se následující označení nejběžnějších derivátů:

FX Forward
FX-Swap
BUY-Option
SELL-Option
FRA
IRS FIX/FLOAT 6M
CC IRS
Forward Akcie
Forward Bond
Futures

Jedná li se o složitější konstrukce, zejména OTC produkty na bázi opcí, jako např. caps, floors, options atp, používají se pro označení vžitá event. výstižné názvy.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0017	Číslo pokynu obchodu	an16
ECO0019	IČ nebo RČ investora	an 30
ECO0045	IČ nebo RČ protistrany	an 30
ECO0046	Účet	an 1
ECO0047	Zobchodovaný nebo převedený počet kusů	n11
ECO0048	Realizovaná cena	n11 2
ECO0049	Měna - obchod	an3
ECO0050	Měna - zdroj	an3
ECO0051	Měna - kurz	n11 2
ECO0052	Předání pokynu - datum	d3

Popis DO pro DS

Strana:27/38

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_22

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0053	Předání pokynu - čas	d7
ECO0054	Zobchodování - datum	d3
ECO0055	Zobchodování - čas	d7
ECO0056	Vypořádání - sjednané datum	d3
ECO0057	Vypořádání - konečné datum	d3
ECO0058	Úplata třetí osoby	n11 2
ECO0059	Úplata třetí osoby - měna	an3

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0900	Pořadové číslo	Několik : n3_I1	Interval nad DT n3

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0517	Vazba na části deníku OCP	Položka : 04	Uskutečněné obchody s veřejně obchodovanými deriváty

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_22

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze: 1.0

Stav: Platný

Platnost od: 01.01.2007

Zdroj:

Garant: /

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_23

Název: Údaje o obchodech (OTC deriváty)

Charakteristika:

Datová oblast obsahující evidenci obchodů, jejichž předmětem je OTC derivátový nástroj. Jednotlivé pokyny jsou jednoznačně určeny číslem pokynu.

Číslo pokynu obchodu je 16 místný textový údaj, jehož prvních 11 znaků tvoří jednoznačnou identifikaci pokynu, přijatého od zákazníka k obstarání investiční služby (k nákupu či prodeji investičního instrumentu). Zbylých 5 znaků slouží identifikaci hromadných pokynů. Nejde-li o hromadný pokyn (nebo obchod na základě hromadného pokynu), bude zde 5 nul, např. u OTC derivátů. Číslo pokynu se shoduje s čísly jednotlivých obchodů provedených na základě pokynu. Pokud bude pokyn od zákazníka uspokojován postupně (dílčími obchody), budou mít obchody na základě tohoto pokynu vždy shodných všech 16 znaků, čímž bude zajištěno jednoznačné přiřazení každého obchodu k pokynu, na jehož základě byl obchod uskutečněn. Sdružuje-li obchodník pokyny, budou mít jak sdružené pokyny, tak i vzniklý hromadný(é) pokyn(y) shodných prvních 11 znaků, zbylých 5 znaků bude číslováno od 00001 nebo od 00000. Typickým (ale ne výlučným) případem použití zde bude poskytování služeb v rámci "asset managementu", pokud portfoliomanager agreguje pokyny pro více zákazníků na základě stejné investiční strategie.

V položkách "Makléř..." se uvádí příjmení všech makléřů, kteří prováděli odborné obchodní činnosti související s obchodem podle vyhlášky č 259/2004 Sb., o druzích odborných obchodních činnostech obchodníka s cennými papíry vykonávaných prostřednictvím makléře, o druzích odborné specializace makléře a o makléřské zkoušce, ve znění pozdějších předpisů. Například v případě asset managementu (vlastní realizace) bude uvedeno minimálně příjmení portfoliomanagera zadávajícího pokyn a příjmení makléře, který prováděl odborné obchodní činnosti v souvislosti s plněním pokynu.

Obecné pokyny pro vyplňování výkazu:

V případě numerických položek, kdy je třeba vyjádřit skutečnost, že položka má nulovou hodnotu, musí být vyplněna nula, buňka nesmí zůstat prázdná (např. "Výše úplaty související s obstaráním nákupu" je nulová, tuto skutečnost je nutno vyjádřit hodnotou nula). Buňka zůstane prázdná pouze v případech, kdy její vyplnění nedává smysl (např. "Podkladové aktivum - spot rate" se nevyplní, není-li tato cena známa, neboť vyplnění nulou by poskytlo nepravdivou informaci).

V případě textových položek se buňky, jejichž vyplnění nedává smysl, nebo jejichž hodnotu nelze zjistit, vyplní hodnotou "N/A" (např. jméno u právnické osoby). Pokud by správnou hodnotou buňky byl prázdný řetězec, buňka se nevyplní.

Údaje o datumu a čase se oddělují do dvou položek, numerické vyjádření těchto položek je třeba přizpůsobit této okolnosti, tj. datový údaj musí být oddělen od desetinné části určující konkrétní časový údaj. Není-li datum známo, položka zůstane nevyplněna.

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_23

Charakteristika:

Vyplňované hodnoty se zaokrouhlují na v praxi používaný počet desetinných míst.

Datový formulář je rozdělen do několika datových oblastí, přičemž v obou tabulkách pokynů musí být číslo pokynu unikátní, tzn. nesmí se v dané tabulce opakovat, musí mu náležet právě jeden pokyn (a nesmí zůstat nevyplněné). V tabulkách obchodů se naopak vícenásobný výskyt předpokládá, a to u obchodů, které se váží na jeden pokyn (např. operace typu repo, kde k pokynu stačí jeden řádek).

Identifikační číslo, resp. rodné číslo, v tabulce osob musí být taktéž unikátní a musí být vždy vyplněno. Tabulka osob musí obsahovat úplný seznam osob, které ve vykazovaných pokynech a obchodech za hlášené období vystupují jako zadavatel, investor nebo protistrana.

Datový formulář byl vytvořen s maximálním ohledem na stávající způsob (formát) zasílání dat Burze cenných papírů. Přestože je rozsah deníku obchodníka mnohem rozsáhlejší, vyskytuje se zde dost společných položek. U některých však bylo třeba upravit způsob vyplňování kódů, eventuálně upravit jejich délku. Před odesláním souboru je v zájmu obchodníka, aby si překontroloval nejen správnost použitých kódů či zkratk, ale i správnost formátu a délky položek.

Dalšími kontrolovanými údaji jsou datumové a časové položky. Kontrolovány jsou následující časové posloupnosti :

datum zobchodování <= start date <= platnost, maturita

Evidence nestandardizovaných (OTC) derivátů

OTC deriváty se evidují ve zjednodušené zvláštní datové oblasti "Údaje o obchodech (OTC deriváty)", která se propojuje pouze s tabulkou osob. Pole "Číslo pokynu obchodu" má shodné parametry jako u předchozích evidencí, avšak nepočítá se zde s hromadnými pokyny a číslování se provádí i na posledních místech.

Pole "Realizovaná cena" a "Měna - obchod" se vyplňují pouze v případech, kdy má kontrakt v době sjednávání cenu, kterou obchodník hradí (nebo obdrží), půjde typicky o opční prémii.

Pro označení derivátu jsou vyhrazena dvě pole:

"Derivát - ID" slouží především k vlastnímu (internímu) označení derivátu, může sloužit k propojení s informačním systémem obchodníka,

"Derivát - typ, druh" znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, jako např "BUY-Option", "IRS FIX/FLOAT 6M" atp.

Položky "Podkladové aktivum - ID" a "Podkladové aktivum - název" se vyplní analogicky jako u derivátů veřejně obchodovaných, nebo zůstanou volné, pokud podkladovým aktivem není nástroj (obvykle cenný papír), na který by je bylo možno aplikovat.

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_23

Charakteristika:

"Podkladové aktivum - množství" je počet kusů podkladového aktiva, pokud by se kontrakt nevztahoval na jednu jednotku podkladového aktiva. V případě, že je podkladovým aktivem úrokový nebo měnový nástroj, uvede se nominální hodnota, na kterou se kontrakt vztahuje, nebo od které se odvozuje plnění.

U FX swapu odpovídá položka "Podkladové aktivum - spot rate" spotovému kurzu a "Podkladové aktivum - strike deal rate" forwardovému kurzu.

U FX transakcí se položka "Podkladové aktivum - spot rate" vztahuje k první měně měnového páru ("Podkladové aktivum - měna 1").

U FRA je "Podkladové aktivum - strike deal rate" sazba dohodnutá mezi obchodníky, "Podkladové aktivum - spot rate" je sazba, na jejímž základě dochází k plnění.

U opcí je "Podkladové aktivum - strike deal rate" cena, za kterou může být nakoupeno podkladové aktivum v případě, že bude uplatněno právo vyplývající z derivátu (realizační cena).

Směr transakce nemá samostatné pole a je dán znaménkem položky "Podkladové aktivum - množství" (+ pro nákup, - pro prodej).

Typ opce (call, put) se odvodí z položky "Derivát - typ, druh" a znaménka položky "Podkladové aktivum - množství".

"Zobchodování - datum", "Zobchodování - čas", "Start date", "Platnost, maturita" jsou data uzavření obchodu, počátku smluvního vztahu a vypršení smluvního vztahu. Ne vždy se tato data musí shodovat s daty vypořádání, v některých případech je nebude možné vyplnit (např. "Start date" u FX forwardu).

U složitějších konstrukcí, se jednotlivé položky vyplní pouze tam, kde mají význam, v položce poznámka se doplní stručný a výstižný komentář.

Forwardem se rozumí obchod, kde čas pro vypořádání překračuje zvyklosti trhu.

Označování derivátů

Položka "Derivát - typ, druh" je vždy povinná a je klíčová pro základní rozdělení derivátů. Znamená srozumitelné, výstižné a obecně uznávané označení derivátu, přičemž z označení nemusí vyplývat žádný údaj o podkladovém aktivu, tyto informace jsou obsaženy v dalších položkách. Předpokládá se následující označení nejběžnějších derivátů:

FX Forward

FX-Swap

BUY-Option

SELL-Option

FRA

IRS FIX/FLOAT 6M

CC IRS

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOC050_23

Charakteristika:

Forward Akcie
Forward Bond
Futures

Jedná li se o složitější konstrukce, zejména OTC produkty na bázi opcí, jako např. caps, floors, options atp, používají se pro označení vžitě event. výstižné názvy.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0017	Číslo pokynu obchodu	an16
ECO0039	Makléř 1	an 30
ECO0040	Makléř 2	an 30
ECO0045	IČ nebo RČ protistrany	an 30
ECO0048	Realizovaná cena	n11 2
ECO0049	Měna - obchod	an3
ECO0054	Zobchodování - datum	d3
ECO0055	Zobchodování - čas	d7
ECO0060	Derivát - ID	an 30
ECO0063	Derivát - typ, druh	an 30
ECO0064	Podkladové aktivum - ID	an 30
ECO0065	Podkladové aktivum - název	an 30
ECO0066	Podkladové aktivum - množství	n11 2
ECO0068	Platnost, maturita	d3
ECO0069	Vysvětlivka	an80
ECO0072	Podkladové aktivum - měna 1	an3
ECO0073	Podkladové aktivum - měna 2	an3
ECO0074	Podkladové aktivum - spot rate	n11 2
ECO0075	Start date	d3
ECO0101	Podkladové aktivum - strike deal rate	n11 2

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0900	Pořadové číslo	Několik : n3_I1	Interval nad DT n3

Popis DO pro DS

Strana:33/38

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_23

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0517	Vazba na části deníku OCP	Položka : 05	Obchody s OTC deriváty

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_23

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:
Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze: 1.0
Zdroj:

Stav: Platný
Garant: /

Platnost od: 01.01.2007

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_33

Název: Údaje o osobách

Charakteristika:

Datová oblast, která eviduje údaje o zadavatelských pokynů, investorech a protistranách obchodu.

V případě zadavatele jde o případy pokynů v rámci asset managementu, dále o pokyny podávané na základě plných mocí, o pokyny podávané investičními zprostředkovateli, kteří jsou smluvními partnery obchodníka, a analogicky o pokyny podávané obchodníkovi k provedení tzv. introducing brokery (tj. obchodníky s cennými papíry, kteří pokyn od zákazníka přijmou a k provedení ho předají jinému obchodníkovi). V rámci asset managementu se uvede osoba obchodníka. Je-li zadavatelem právnická osoba, uvádí se tato osoba, nikoli její zaměstnanci nebo pověřené osoby. Osoba zadavatele se neuvádí, jestliže je zákazníkem právnická osoba nebo fyzická osoba podnikatele a pokyn podává její zaměstnanec nebo statutární či obdobný zástupce.

Investorem se rozumí zásadně zákazník, pokud se však jedná o obchod na vlastní účet obchodníka, rozumí se investorem obchodník.

Protistranou se v případě obchodů na regulovaném trhu obecně rozumí osoba, se kterou byl obchod uzavřen. Není-li tato známa, pak se uvede obchodník, není-li znám, pak přímo trh. Dává-li trh k dispozici pouze registrační číslo protistrany přidělené tímto trhem, použije obchodník toto číslo, a v tabulce osob doplní u ostatních údajů hodnotu "N/A". Jedná-li se o obchody uzavřené mimo regulovaný trh, bude protistranou osoba, se kterou se obchod uzavírá (buď obchodník nebo jiná osoba).

Jako identifikační číslo osoby se uvede IČ nebo zahraniční obdoba IČ u právnické osoby, nebo rodné číslo u fyzické osoby. Rodné číslo se pro potřeby výkaznictví uvádí bez lomítka mezi šestým a sedmým místem (pouze číselné hodnoty). Pokud údaj o IČ, rodném čísle (případně jeho obdobě) neexistuje, přidělí obchodník této osobě vlastní jednoznačnou identifikaci v textovém formátu a tuto skutečnost deklaruje tím, že do pole "Pseudo" v tabulce osob vyplní svoje vlastní IČ.

Identifikační číslo, resp. rodné číslo, v tabulce osob musí být unikátní a musí být vždy vyplněno. Tabulka osob musí obsahovat úplný seznam osob, které ve vykazovaných pokynech a obchodech za hlášené období vystupují jako zadavatel, investor nebo protistrana.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ECO0102	Pseudo	

Datový typ údajů v datové oblasti:

an10 - an10 (10 abecedně číselných znaků)

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_33

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0025	Země (stát)	Několik : D S VSEZEME2	Všechny země
P0058	Objekt vykazování - právnická, fyzická osoba	Několik : an10_I1	Interval nad DT an10
P0059	Jméno nebo zkrácený název osoby	Několik : an__30_I1	Interval nad DT an__30
P0204	Adresa - ulice, číslo	Několik : an_35_I1	Doména nad dat. typem an_35
P0206	Adresa - obec	Několik : an_35_I1	Doména nad dat. typem an_35
P0208	Příjmení občana	Několik : an_35_I1	Doména nad dat. typem an_35

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0517	Vazba na části deníku OCP	Položka : 06	Údaje o osobách

Datový soubor: DOCOS51

Akronym: OCP (ČNB) 51-04

Datová oblast: DOCO50_33

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze: 2.0

Stav: Platný

Platnost od: 01.01.2007

Zdroj:

Garant: /