SDAT – sběr dat



Říjen 2014

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

Říjen 2014

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

Říjen 2014

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

**SDAT – testování metodiky vykazovacího rámce MKT**

***Verze: 1.1***

**Identifikace dokumentu**

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

**Historie dokumentu**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Datum** | **Verze** | **Popis verze a změn oproti verzi předchozí** |
| 2022-03-07 | 1.0 | Úvodní verze dokumentu* Testování MVK – TRAF11\_01
* Testování přechodného stavu - PNDG
 |
| 2022-03-25 | 1.1 | Nové kapitoly* 1.2. Vykazovací povinnosti, uzavírání Výskytů výkazu
* 1.3.1. Spuštění zpracování MVK¨
* 1.4 Testování SETF50\_01
 |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |

**Obsah**

[1. Testování mezivýkazových kontrol 4](#_Toc99526679)

[1.1. Úvod 4](#_Toc99526680)

[1.2. Vykazovací povinnosti, uzavírání Výskytů výkazu 4](#_Toc99526681)

[1.3. TRAF11\_01 5](#_Toc99526682)

[1.4. SETF50\_01 7](#_Toc99526683)

[2. Testování přechodného stavu PNDG (pouze výkaz TRAFIM10) 10](#_Toc99526684)

[2.1. Úvod 10](#_Toc99526685)

[2.2. Scénář PNDG => RJCT 10](#_Toc99526686)

[2.3. Scénář PNDG => ACPT 10](#_Toc99526687)

#

# Testování mezivýkazových kontrol

## Úvod

Vykazovací rámec MKT v aktuálně platné metodice (MKT20201101) obsahuje 3 Skupiny MVK:

* **TRAF11\_01:** Kontroly mezi výkazy TRAFIM11, TRAFIM10, TRAFIM20, TRAFIM30, REFFIM10, PERFIM30**;**
* **SETF50\_01:** Kontroly mezi výkazy SETFIM50, REFFIM20, PARFIM40**;**
* **TRAF12\_01:** Kontroly mezi výkazy TRAFIM12, TRAFIM10, TRAFIM40**.**

Dané Skupiny MVK se pak dělí do jednotlivých setů (viz Výkazy - Detail výkazu - Kontroly MVK - Skupiny). Dané sety jsou pak tvořeny tak, aby věcně spojily vybrané transakční výkazy (nebo jeden) a výkaz/výkazy číselníkové (žádný, jeden, více). Sety jsou tvořeny na základě věcné vazby.



Vlastníkem Skupiny MVK je vždy transakční výkaz (tedy TRAFIM11 nebo TRAFIM12 nebo SETFIM50 v závislosti na Skupině MVK).

**Proces zpracování MVK bude spouštěn 1 x denně v ranních hodinách.**

Další informace k vykazovacímu rámci MKT a jeho implementaci v SDAT jsou dostupné na adrese <https://www.cnb.cz/cs/statistika/sdat/mkt/>

## Vykazovací povinnosti, uzavírání Výskytů výkazu

Režim testování odpovídá reálnému režimu uzavírání Výskytů výkazu, který bude použit v produkci. Takto jsou nastaveny vykazovací povinnosti a probíhají tak procesy systému spojené s uzavíráním Výskytů výkazů.

Velmi doporučujeme posílat data na Výskyty výkazu podle dohodnutého schématu vykazování, viz dokument <https://www.cnb.cz/export/sites/cnb/cs/statistika/.galleries/sdat/SDAT_MKT_vyskyty_zmena_1_0.docx>, kapitola Navrhovaný stav.

Zasláním dat na Výskyt výkazu v budoucnosti (např. 30.5.2022) dochází k zamčení všech předchozích Výskytů výkazu!

## TRAF11\_01

### Spuštění zpracování MVK

Pro spuštění zpracování MVK (běhu skupiny MVK) musí být splněny následující podmínky:

* neexistuje žádné poslední přijaté Vydání výskytu výkazu v dané Skupině MVK, které je odmítnuto jako celek na formální/formátové chyby.
* existuje Vydání výskytu výkazu TRAFIM11,
* existují Vydání výskytů výkazů účastníků některé ze skupiny kontrol (set1 – set 10),

**Spuštění běhu skupiny MVK je provedeno na základě zaslání Vydání výskytu výkazu jakéhokoliv účastníka skupiny MVK**. Tento proces není spouštěn okamžitě, ale 1 x denně v ranních hodinách v návaznosti na uzavření Výskytů výkazu z předchozího dne.

Jaké transakce a číselníkové záznamy do zpracování vstoupí je popsáno v následující kapitole.

### Transakce a číselníkové záznamy vstupující do MVK

**Transakční výkazy**

V rámci zpracování MVK se u transakčních výkazů kontrolují aktuálně platné akceptované (ACPT) a čekající (PNDG - pouze výkaz TRAFIM10) transakce na základě provedení jednovýkazových kontrol (JVK).

Transakce, které již jednou prošly úspěšně MVK kontrolami a nebyla na nich provedena změna, do MVK opakovaně nevstupují.

MVK na transakčních jsou tedy prováděny pro transakce, které jsou od posledního spuštění zpracování MVK:

* nové a po provedení JVK ve stavu akceptované a čekající,
* změněné a po provedení JVK ve stavu akceptované,
* došlo ke změně stavu transakce z čekající (PNDG) na odmítnutý (RJCT),
* chybné po předchozím běhu zpracování MVK.

**Číselníkové výkazy**

* Do kontrol vstupují vždy aktuálně platná data tohoto Výkazu za danou Vykazující osobu.

### Zahájení testování

**Zaslání a zpracování dat číselníkových a transakčních výkazů**

* V prvním kroku zaslat číselníkové výkazy PERFIM30 a REFFIM10 a v protokolu zkontrolovat, že zaslané záznamy "Položek číselníku" byly akceptované (pouze akceptovaná data jsou používána v MVK).
* Tento krok lze vynechat, pokud má Osoba v SDAT TEST již akceptovaná potřebná data číselníkových výkazů.
* V případě existence odmítnutých dat číselníkových výkazů je třeba zvážit, zda mají být data pro prováděný test MVK opravena a případně zaslat jejich opravu.
* V druhém kroku zaslat záznamy Transakcí výkazů TRAFIM10, TRAFIM20 a TRAFIM30 (nemusí být zaslány všechny výkazy, stačí zaslat výkazy, které má Osoba připraveny) a v protokolu zkontrolovat, zda byly záznamy Transakcí akceptované (ACPT) nebo jsou ve stavu čekající (PDNG) (pouze tato data se účastní MVK).
* Tento krok lze vynechat, pokud má Osoba v SDAT TEST již akceptované Transakce, nad kterými mají být provedené MVK.
* V případě existence odmítnutých dat transakčních výkazů je třeba zvážit, zda mají být data pro prováděný test MVK opravena a případně zaslat jejich opravu.
* Ve třetím kroku zaslat záznamy Transakcí výkazu TRAFIM11 a v protokolu zkontrolovat, zda byla záznamy Transakcí akceptované (ACPT) (pouze tato data se účastní MVK).
* Tento krok lze vynechat, pokud má Osoba v SDAT TEST již akceptované Transakce, nad kterými mají být provedené MVK.
* V případě existence odmítnutých dat transakčních výkazů je třeba zvážit, zda mají být data pro prováděný test MVK opravena a případně zaslat jejich opravu.
* Po zpracování Vydání výskytu výkazu TRAFIM11 se vytvoří tzv. Plán MVK pro Skupinu TRAF11\_01



**Zpracování MVK**

* Pokud byl pro Osobu úspěšně zpracován výkaz TRAFIM11, dojde v SDAT TEST ke zpracování aktivovaných MVK nad množinou akceptovaných (ACPT) nebo čekajících (PDNG - pouze výkaz TRAFIM10) Transakcí. Výsledky budou k dispozici v protokolu o zpracování MVK.



### Pokračování testování

**Zaslání a zpracování dat číselníkových a transakčních výkazů**

* V případě potřeby zaslat chybějící záznamy nebo jiné změny dat číselníkových výkazů PERFIM30 a REFFIM10 a v protokolu zkontrolovat, že zaslané záznamy "Položek číselníku" byly akceptované.
* V případě existence odmítnutých dat číselníkových výkazů je třeba zvážit, zda mají být data pro prováděný test MVK doplněna nebo opravena a případně zaslat jejich opravu či doplnění.
* Pro MVK bude používán aktualizovaný stav všech platných záznamů "Položek číselníku" daných číselníkových výkazů za vykazující osobu.
* Zaslat opravy Transakcí, které byly v protokolu o zpracování MVK uvedeny jako chybné (RJCT). V protokolu o zpracování Vydání výskytu výkazu zkontrolovat, zda byly záznamy Transakcí po provedení JVK akceptované (ACPT) nebo jsou ve stavu čekající (PDNG - pouze výkaz TRAFIM10).
* Ve výkazech TRAFIM10, TRAFIM20 a TRAFIM11 musí být zasláno zrušení Transakce a následně musí být Transakce zaslána jako nová.
* Ve výkazu TRAFIM30 zaslat změnu Transakce (T0024 = 'AMND').
* .
* Zaslat případně chybějící Transakce a v protokolu o zpracování Vydání výskytu výkazu zkontrolovat, zda byly záznamy Transakcí akceptované (ACPT) nebo jsou ve stavu čekající (PDNG - pouze výkaz TRAFIM10).

**Zpracování MVK**

* Pokud bylo pro Osobu úspěšně zpracováno nějaké Vydání výkazu TRAFIM11, TRAFIM10, TRAFIM20 nebo TRAFIM30, dojde v SDAT TEST ke zpracování aktivovaných MVK nad množinou změněných akceptovaných (ACPT) nebo čekajících (PDNG - pouze výkaz TRAFIM10) Transakcí nebo chybných Transakcí. Výsledky budou k dispozici v protokolu o zpracování MVK. Transakce, které již jednou prošly úspěšně MVK kontrolami a nebyla na nich provedena změna, nebudou do MVK opakovaně vstupovat.

## SETF50\_01

### Spuštění zpracování MVK

Pro spuštění zpracování MVK (běhu skupiny MVK) musí být splněny následující podmínky:

* neexistuje žádné poslední přijaté Vydání výskytu výkazu v dané Skupině MVK, které je odmítnuto jako celek na formální/formátové chyby.
* existuje Vydání výskytu výkazu SETFIM50,
* existují Vydání výskytů výkazů účastníků,

**Spuštění běhu skupiny MVK je provedeno na základě zaslání Vydání výskytu výkazu jakéhokoliv účastníka skupiny MVK.** Tento proces není spouštěn okamžitě, ale 1 x denně v ranních hodinách v návaznosti na uzavření Výskytů výkazu z předchozího dne.

Jaké transakce a číselníkové záznamy do zpracování vstoupí je popsáno v následující kapitole.

### Transakce a číselníkové záznamy vstupující do MVK

**Transakční výkazy**

V rámci zpracování MVK se u transakčních výkazů kontrolují aktuálně platné akceptované (ACPT) transakce na základě provedení jednovýkazových kontrol (JVK).

Transakce, které již jednou prošly úspěšně MVK kontrolami a nebyla na nich provedena změna, do MVK opakovaně nevstupují.

MVK na transakčních jsou tedy prováděny pro transakce, které jsou od posledního spuštění zpracování MVK:

* nové a po provedení JVK ve stavu akceptované a čekající,
* změněné a po provedení JVK ve stavu akceptované,
* chybné po předchozím běhu zpracování MVK.

**Číselníkové výkazy**

* Do kontrol vstupují vždy aktuálně platná data tohoto Výkazu za danou Vykazující osobu.

### Postup testování Zaslání a zpracování dat číselníkových a transakčních výkazů

* V prvním kroku zaslat číselníkové výkazy PARFIM40 a REFFIM20 a v protokolu zkontrolovat, že zaslané záznamy "Položek číselníku" byly akceptované (pouze akceptovaná data jsou používána v MVK).
* Tento krok lze vynechat, pokud má Osoba v SDAT TEST již akceptovaná potřebná data číselníkových výkazů.
* V případě existence odmítnutých dat číselníkových výkazů je třeba zvážit, zda mají být data pro prováděný test MVK opravena a případně zaslat jejich opravu.
* V druhém kroku zaslat záznamy Transakcí výkazu SETFIM50 a v protokolu zkontrolovat, zda byly záznamy Transakcí akceptované (ACPT) (pouze tato data se účastní MVK).
* Tento krok lze vynechat, pokud má Osoba v SDAT TEST již akceptované Transakce, nad kterými mají být provedené MVK.
* V případě existence odmítnutých dat transakčních výkazů je třeba zvážit, zda mají být data pro prováděný test MVK opravena a případně zaslat jejich opravu.
* Po zpracování Vydání výskytu výkazu SETFIM50 se vytvoří tzv. Plán MVK pro Skupinu SETF50\_01.

**Zpracování MVK**

* Pokud byl pro Osobu úspěšně zpracován výkaz SETFIM50, dojde v SDAT TEST ke zpracování aktivovaných MVK nad množinou akceptovaných (ACPT) Transakcí. Výsledky budou k dispozici v protokolu o zpracování MVK.

### Pokračování testování

Další testování je analogické s kapitolou 1.3.4.

# Testování přechodného stavu PNDG (pouze výkaz TRAFIM10)

## Úvod

Cílem scénářů je otestovat přechod transakce z přechodného stavu pending (PNGD) do cílových stavů Accepted (ACPT) nebo Rejected (RJCT) na základě interpretace příslušných JVK kontrol.

Pro test je klíčový obsah číselníku FIRDS\_FININSTRUMENTS v okamžiku prvního nebo opakovaného zpracování transakce.

Opakované zpracování transakcí ve stavu PNDG je navázáno na denní aktualizaci externích číselníků ESMA. Transakce v uvedeném stavu po dobu 7 dní vstupují do opakovaného zpracování a jsou znovu vyhodnocovány příslušné kontroly vůči aktualizovaným číselníkům.

## Scénář PNDG => RJCT

Pro test lze použít jakýkoliv ISIN nevyskytující se ve FIRDS číselníku, dle vlastního uvážení. Lze např. použít ISIN kódy ze země Arabské Emiráty: AEA003001012, AED000901010. Po 7 dnech bude transakce převedena do stavu RJCT.

## Scénář PNDG => ACPT

Přípravu pro tento scénář je třeba dohodnout na mailu [sdat@cnb.cz](file:///C%3A%5CUsers%5CU00019%5CAppData%5CLocal%5CMicrosoft%5CWindows%5CINetCache%5CContent.Outlook%5C0IYPXBRF%5Csdat%40cnb.cz). Probíhat bude přibližně takto:

1. Dohodnutý den před 9:00 správa systému ČNB odstraní z číselníku FIRDS\_FININSTRUMENTS platný záznam s kódem dohodnutého ISINu. Výběr platného záznamu ISIN je potřeba volit v souladu s vyplněním pole FIM0041 Datum a čas obchodování.
2. Transakce s tímto ISIN kódem zaslané od 9:00 přibližně do 15:00 budou přijaty do stavu PNDG.
3. Pravidelná automatická denní aktualizace číselníku FIRDS\_FININSTRUMENTS. (ZPRAC\_FIRDS\_FININSTRUMENTS) vrátí zpět záznam pro smazaný ISIN kód. Aktualizace je spouštěna cca v 15:30 hod.
4. Následný proces opakovaných kontrol (ZPRAC\_JVK\_OPAK\_TRAN) převede transakce s dohodnutým kódem ISIN do stavu ACPT. Proces je spouštěn cca v 17:00.