

Formát verejne dostupných predobchodných a poobchodných dát BCPB

(aktualizované: 30.12.2022)

Burza cenných papierov v Bratislave, a.s. (BCPB) poskytuje verejnosti prostredníctvom verejného rozhrania výstup predobchodných a poobchodných dát v strojovo spracovateľnej forme. Informácie poskytujú reálny obraz o dianí na spotovom trhu, pričom základné dáta sú prístupné bez oneskorenia, obchodné potom s oneskorením 15 minút. Každý typ dát tvorí súbor údajov pre zvolený obchodný deň, pričom je možné zvoliť spätný dátum pre sedem kalendárnych dní od aktuálneho dňa.

Predobchodné dáta :

- Statické údaje cenných papierov – Akcie (súbor **CPA001A**)
- Statické údaje cenných papierov – Dlhopisy (súbor **CPAD01A**)
- Objednávky (súbor **OBJK01A**) *
- Objednávky Tvorcov trhu (súbor **OBJT01A**) *

Poobchodné dáta :

- Dynamické údaje cenných papierov – Akcie (súbor - **CPAD01A**) *
- Dynamické údaje cenných papierov – Dlhopisy (súbor- **CPDD01A**) *
- Obchody (súbor **OB0001A**) *
- Zrušené obchody (súbor **ZO0001A**)

Poznámka : * Súbor údajov označených hviezdikou, obsahujú údaje s oneskorením 15 minút.

Popis formátu prenosu

Údaje uvedené v súboroch sú poskytované BCPB, t.j. údaje sú produkované Burzou a odberateľ si zabezpečí ich ďalšie spracovanie. Jednotlivé vety v súbore sú usporiadané podľa času ich vzniku v daný deň, pričom prvým údajom je vždy dátum a čas vzniku danej vety :

DDMMYYYYHHMMSS#

Požiadavku na zaslanie údajov predobchodných a poobchodných dát je možné zadať na webovej stránke BCPB : <https://www.bsse.sk/predobchodne-a-poobchodne-data/> , pričom je možné vybrať typ údajov, dátum obchodného dňa (maximálne sedem kalendárnych dní od aktuálneho dňa.). Je potrebné zadať mailovú adresu, na ktorú bude následne zaslaný ZIP súbor s požadovanými súbormi údajov.

Údaje uvedené v súboroch môžu vznikať v rôznych fázach obchodného dňa :

Ranný prenos (R). Prenášajú sa sumárne informácie o stave na burze pred začiatkom obchodovania.

Denný priebežný prenos (D). Prenášajú sa aktuálne informácie o vývoji obchodovania na BCPB.

Poobedňajší prenos (P). Prenášajú sa sumárne informácie o stave na burze po dennej uzávierke obchodovania.

Čas generovania

Vety v CPA001A	; R
Vety v CPD001A	; R
Vety v CPAD01A	; D
Vety v CPDD01A	; D
Vety v OB0001A	; D
Vety v ZO0001A	; D
Vety v OBJK01A	; R, D
Vety v OBJT01A	; R, D

Poznámka :

Pre jednotlivé údaje vo vete majú fixnú dĺžku a platí, že ak pole nemá priradenú hodnotu, vo vetách sa bude nachádzať preddefinovaná hodnota a to v prípade:

- reťazcov - medzery
- čísel - znak '0' (ASCII 48)
- dátumu - znaky '00000000' (ASCII 48 x 8)
- času - znaky '000000' (ASCII 48 x 6)
- logických premenných - znak 'N' (nie)

Ak reálna hodnota poľa nezaberá preddefinovanú veľkosť vo formáte, budú jednotlivé polia zarovnávané:

- napravo v prípade čísel,
- naľavo v prípade reťazcov.

Poznámka:

V prípade číselných položiek je oddeľovačom desatinných miest bodka.

Poznámka:

Harmonogram obchodného dňa na BCPB pozostáva z časových intervalov (T10 až Tn). Tieto časové intervaly určujú i čas generácie jednotlivých správ.

<i>Čas</i>	<i>Aktivita</i>
T40 – 30 min.	Ranný prenos
T40 – 10 min.	Povolenie denného priebežného prenosu
T50 + 20 min.	Zakázanie denného priebežného prenosu
T80 + 60 min.	Poobedňajší prenos

Aktuálne Txx hodnoty:

T40 = 11:00

T50 = 15:30

T80 = 16:00

Význam použitých skratiek je nasledovný:

CPA - cenné papiere - akcie, statická časť
CPAD - cenné papiere - akcie, dynamická časť
CPD - cenné papiere - dlhopisy, statická časť
CPDD - cenné papiere - dlhopisy, dynamická časť
OB - obchody uzavreté na BCPB
ZO - zrušené obchody na BCPB
OBJK - objednávky na kúpu a predaj cenných papierov - kontinuálny systém
OBJT - objednávky na kúpu a predaj cenných papierov – modul tvorcov trhu
LEI - Legal Entity Identifier (LEI emitenta)
MIC - identifikačný kód trhu
CFI - klasifikácia finančného nástroja
BTI - Identifikátor typu dlhopisu (EUSB-Sovereign, OEPB-Other Public, CVTB-Convertible, CVDB-Covered, CRPB-Corporate, OTHR-Other)
BSI –Identifikátor typu dlhopisu – seniorita (SNDB-Senior Debt, MZZD-Mezzanine, SBOD-Subordinated Debt, JUND-Junior Debt)

Použité číselné označenie Burzových trhov (Trh)

Trh	segment	názov	stav	skratka	MIC
1	0	Kótovaný	A	K	XBRA
2	0	Registrovaný	V		XBRA
3	0	Regulovaný vo 3/4ný	A	V	XBRA
4	0	Mnohostranný obchodný systém	A	M	EBRA
11	1	Kótovaný hlavný	A	H	XBRA
12	1	Kótovaný paralelný	A	P	XBRA
13	1	Kótovaný nový	V	N	XBRA

Hodnoty položky stav:

A – aktívny

S – suspendovaný, pozastavený

V – vyradený, zrušený

CPA001A - Názov: Cenné papiere - akcie, statická časť.

Popis: Vety obsahujú identifikácie viet cenných papierov akcií, obchodovaných na burze. Obsahujú údaje, ktoré sa počas dňa nemenia a sú platné pre celý deň.

	Typ/Formát	Dĺžka	
<Veta CPA001A> ::=			
<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8	
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6	
#	; A	1	
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8	
<Názov CP>	; A/X20	20	
<ISIN>	; A/UU#10	12	
<Jednotková menovitá hodnota>	; N/#7,4	12	
<Dátum emisie>	; D/DDMMYYYY	8	
<Dátum rozhodného dňa>	; D/DDMMYYYY	8	
<Dátum výplaty dividendy>	; D/DDMMYYYY	8	*1
<Dividenda netto>	; N/#7,4	12	
<Výška emisie v ks>	; N/#12	12	
<Meno/Doručiteľ>	; A/U	1	
<Zisk na akciu>	; N/N#11,4	17	
<Druh akcie>	; A/U	1	
<Dátum zistenia ročného zisku>	; D/DDMMYYYY	8	
<Predchádzajúci priemerný kurz>	; N/#7,4	12	
<Dátum predch.priemerného kurzu>	; D/DDMMYYYY	8	
<Ročné maximum kurzu za 365 dní>	; N/#7,4	12	
<Ročné minimum kurzu za 365 dní>	; N/#7,4	12	
<P/E>	; N/N#5,2	9	
<Stred pásma>	; N/#7,4	12	
<Trhová kapitalizácia>	; N/N#11,4	17	
<Trh>	; N/#6	6	
<CFI>	; A/X6	6	
<LEI>	; A/X20	20	

*1 - uvedený dátum výplaty dividendy bude až do zavedenia do obchodného systému BCPB nevyplnený (t.j. rovný 0).

Možné hodnoty položky <Meno/Doručiteľ>:

M – akcia na meno

D – akcia na doručiťľa

Možné hodnoty položky <Druh akcie>:

A - Akcia

P - Podielový list

F - Akcie investičných fondov

L - Družstevné podielnické listy

V- Verejný prísľub

CPAD01A - Názov: Cenné papiere - akcie, dynamická časť.

Popis: Vety obsahujú jednoznačnú identifikáciu cenného papiera a dynamické údaje, ktoré sú preň počítané počas obchodného dňa.

	Typ/Formát	Dĺžka
<Veta CPAD01A> ::=		
<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6
#	; A	1
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8
<ISIN>	; A/UU#10	12
<Minimálna cena>	; N/#7,4	12
<Maximálna cena>	; N/#7,4	12
<Posledná cena>	; N/#7,4	12
<Počet obchodov>	; N/#6	6
<Počet jednotiek>	; N/#12	12
<Objem obchodov>	; N/#11,4	16
<Minimálna požiadavka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Maximálna požiadavka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Minimálna ponuka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Maximálna ponuka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Minimálna požiadavka - bloky>	; N/#7,4	12
<Maximálna požiadavka - bloky>	; N/#7,4	12
<Minimálna ponuka - bloky>	; N/#7,4	12
<Maximálna ponuka - bloky>	; N/#7,4	12

CPD001A - Názov: Cenné papiere - dlhopisy, statická časť.

Popis: Vety obsahujú identifikácie viet cenných papierov dlhopisov, obchodovaných na burze. Obsahujú údaje, ktoré sa počas dňa nemenia a sú platné pre celý deň.

	Typ/Formát	Dĺžka
<Veta CPD001A> ::=		
<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6
#	; A	1
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8
<Názov CP>	; A/X20	20
<ISIN>	; A/UU#10	12
<Jednotková menovitá hodnota>	; N/#7,4	12
<Dátum emisie>	; D/DDMMYYYY	8
<Úroková sadzba>	; N/#2,3	6
<Frekvencia vyplácania v mesiacoch>	; N/#2	2
<Dátum splatnosti>	; D/DDMMYYYY	8
<Najbližší dátum splatnosti>	; D/DDMMYYYY	8
<Výška emisie v ks>	; N/#12	12
<Aktuálna jednotková menovitá hodnota>	; N/#7,4	12
<Druh dlhopisu>	; A/U	1
<Predchádzajúci priemerný kurz>	; N/#7,4	12
<Dátum predch.priemerného kurzu>	; D/DDMMYYYY	8
<Ročné maximum kurzu za 365 dní>	; N/#7,4	12
<Ročné minimum kurzu za 365 dní>	; N/#7,4	12
<Výnos>	; N/#3,2	6
<Stred pásma>	; N/#7,4	12
<Trh>	; N/#6	6
<CFI>	; A/X6	6
<BTI>	; A/X4	4
<BSI>	; A/X4	4
<LEI>	; A/X20	20

Možné hodnoty položky <Druh dlhopisu>:

D – korporátny dlhopis

R – štátny dlhopis

T – štátna pokladničná poukážka

CPDD01A - Názov: Cenné papiere - dlhopisy, dynamická časť.

Popis: Vety obsahujú jednoznačnú identifikáciu cenného papiera a dynamické údaje, ktoré sú preň počítané počas obchodného dňa.

	Typ/Formát	Dĺžka
<Veta CPDD01A> ::=		
<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6
#	; A	1
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8
<ISIN>	; A/UU#10	12
<Minimálna cena>	; N/#7,4	12
<Maximálna cena>	; N/#7,4	12
<Posledná cena>	; N/#7,4	12
<Počet obchodov>	; N/#6	6
<Počet jednotiek>	; N/#12	12
<Objem obchodov>	; N/#11,4	16
<Minimálna požiadavka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Maximálna požiadavka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Minimálna ponuka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Maximálna ponuka – kontinuál>	; N/#7,4	12
<Minimálna požiadavka - bloky>	; N/#7,4	12
<Maximálna požiadavka - bloky>	; N/#7,4	12
<Minimálna ponuka - bloky>	; N/#7,4	12
<Maximálna ponuka - bloky>	; N/#7,4	12

OB0001A - Názov: Obchody uzavreté na BCPB.

Popis: Vety obsahujú podrobné informácie o obchodoch uzavretých obchodným systémom BCPB. Ide o obchody uzavreté v kurzotvorných moduloch obchodného systému. Pre všetky typy je na burze charakteristická anonymita obchodu.

<Veta OB0001A> ::=

<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6
#	; A	1
<Poradové číslo>	; N/#6	6
<Dátum obchodu>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas obchodu>	; T/HHMMSS	6
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8
<ISIN>	; A/UU#10	12
<Nominálna jednotková hodnota>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek>	; N/#12	12
<Kurz>	; N/#7,4	12
<Suma celkom>	; N/#11,4	16
<+Alikv.úrok.výnos>	; N/N#11,4	17
<Typ obchodu>	; A/UU	2
<JIO>	; A/X38	38
<ETF>	; A/X25	25

Možné hodnoty položky <Typ obchodu>:

- A – obchod uzavretý v aukčnom obchodovaní
- K – obchod uzavretý v kontinuálnom obchodovaní
- T – obchod uzavretý v module tvorcov trhu

JIO - jednoznačná identifikácia obchodu
vo formáte: YYYYMMDDThhmmssdddZTZDKnnnnnt

ETF - zoznam zodpovedajúcich MiFID II RTS 1 a RTS2 poobchodných príznakov
transparentnosti (oddelené čiarkou)

ZO0001A - Názov: Zrušené obchody na BCPB.

Popis: Vety obsahujú podrobné informácie o obchodoch zrušených obchodným systémom alebo na príkaz vedúceho obchodovania. Ide o obchody pochádzajúce z kurzotvorných modulov obchodného systému. Pre všetky typy je na burze charakteristická anonymita obchodu.

	Typ/Formát	Dĺžka
<Veta ZO0001A> ::=		
<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6
#	; A	1
<Poradové číslo>	; N/#6	6
<Dátum obchodu>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas obchodu>	; T/HHMMSS	6
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8
<ISIN>	; A/UU#10	12
<Jednotková menovitá hodnota>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek>	; N/#12	12
<Kurz>	; N/#7,4	12
<Suma celkom>	; N/#11,4	16
<+Alikv.úrok.výnos>	; N/N#11,4	17
<Typ obchodu>	; A/UU	2
<JIO>	; A/X38	38
<ETF>	; A/X25	25

Možné hodnoty položky <Typ obchodu>:

A – obchod uzavretý v aukčnom obchodovaní

K – obchod uzavretý v kontinuálnom obchodovaní

T – obchod uzavretý v module tvorcov trhu

JIO - jednoznačná identifikácia obchodu (formát totožný ako pri súbore OB0001A)

ETF - zoznam zodpovedajúcich MiFID II RTS 1 a RTS2 poobchodných príznakov transparentnosti (oddelené čiarkou)

OBJK01A - Názov: Objednávky na kúpu a predaj cenných papierov - aukčný a kontinuálny systém.

Popis: Vety obsahujú informácie o najlepších objednávkach na strane kúpy aj predaja. Vypisovaný je stav v troch najlepšíh hladinách cien.

	Typ/Formát	Dĺžka
<Veta OBJK01A> ::=		
<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6
#	; A	1
<Dátum obchodovania>	; D/DDMMYYYY	8
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8
<ISIN>	; A/UU#10	12
<Počet jednotiek - predaj 1>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - predaj 1>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - predaj 2>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - predaj 2>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - predaj 3>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - predaj 3>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - kúpa 1>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - kúpa 1>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - kúpa 2>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - kúpa 2>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - kúpa 3>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - kúpa 3>	; N/#7,4	12

OBJT01A - Názov: Objednávky na kúpu a predaj cenných papierov – modul tvorcov trhu.

Popis: Vety obsahujú informácie o najlepších objednávkach na strane kúpy aj predaja, do úvahy je braný maximálny počet jednotiek pri objednávkach. Vypisovaný je stav v troch najlepších hladinách cien.

	Typ/Formát	Dĺžka
<Veta OBJT01A> ::=		
<Dátum vzniku vety>	; D/DDMMYYYY	8
<Čas vzniku vety>	; T/HHMMSS	6
#	; A	1
<Dátum obchodovania>	; D/DDMMYYYY	8
<Skratka CP>	; A/#UUU##UX	8
<ISIN>	; A/UU#10	12
<Počet jednotiek - predaj 1>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - predaj 1>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - predaj 2>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - predaj 2>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - predaj 3>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - predaj 3>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - kúpa 1>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - kúpa 1>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - kúpa 2>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - kúpa 2>	; N/#7,4	12
<Počet jednotiek - kúpa 3>	; N/#12	12
<Najlepšia cena - kúpa 3>	; N/#7,4	12

Legenda:

Typy	A	- alphanumeric
	N	- numeric
	T	- čas
	D	- dátum
	L	- logical
Formáty	N	- znamienko +/- (štandardne sa uvádza iba -)
	#	- číslica
	X	- ľubovoľný znak
	U	- veľké písmeno
	L	- malé písmeno

Príklady:

X30	- 30 ľubovoľných znakov. ("Pokusný reťazec.")
N#11	- znamienko '-' nasledované max 11 ciferným celým číslom. ("-12345", "12345678901", "0", "-12345678901").
#7,2	- reálne číslo so siedmimi ciframi v celočíselnej časti a dvomi v desatinnej. Oddeľovačom je znak čiarka ','. ("1234567,12", "0,01", "0,00")
#UUU##UX	- číslica nasledovaná tromi veľkými písmenami, nasledujú dve číslice, veľké písmeno a ľubovoľný znak. ("1SLN01A", "2XXX01C*")