

Wymogi w zakresie formatu i zawartości plików parametryzacyjnych w Systemie Obsługi ETP

W Systemie Obsługi ETP obowiązują następujące wymogi co do formatu i zawartości plików parametryzacyjnych dla produktów strukturyzowanych, objętych wnioskiem o dopuszczenie i wprowadzenie do obrotu giełdowego:

- 1) Format pliku: .csv, kodowanie: UTF-8
- 2) Wymogi dla kolejnych pól pliku parametryzacyjnego:
 - INSTRUMENT ISIN CODE: Obligatoryjne, tekst 12 znaków, nazwa unikalna, sprawdzane przy ładowaniu pliku;
 - INSTRUMENT WSE CODE NAME: Obligatoryjne, tekst, do 18 znaków, nazwa unikalna, sprawdzane przy ładowaniu pliku;
 - NUMBER OF SECURITIES: Obligatoryjne, liczba, 11 cyfr;
 - ISSUE PRICE: Obligatoryjne 12,6 cyfr (12 cyfr, 6 cyfr po przecinku);
 - ISSUE PRICE CURRENCY: Obligatoryjne, 3 znaki, jedno z listy: PLN; EUR; USD; CHF; JPY; GBP; HUF; CZK; AUD; CAD; DKK; HKD; NOK; RUB; SEK; UAH; BGN; RON; HRK;
 - DATE OF ISSUE: Obligatoryjne, YYYY-MM-DD;
 - FIRST TRADING DAY: Obligatoryjne, YYYY-MM-DD (proponowany pierwszy dzień notowań) jeśli plik przesłany do 12:00 dnia sesyjnego – nie wcześniej niż D+2; jeśli plik złożony po 12:00 dnia sesyjnego – nie wcześniej niż D+3; pierwszy dzień notowań – nie później niż 20 dni od złożenia wniosku;
 - LAST TRADING DATE: Obligatoryjne, YYYY-MM-DD lub "OPEN END";

- TYPE OF INSTRUMENT: Obligatoryjne, jedno z listy: Option warrants, Factor certificates, Turbo certificates, Capital protection certificates, Bonus certificates, Reverse convertible certificates, Express certificates, Discount certificates, Index/tracker certificates, Other investment certificates (non leveraged), Structured notes;
- TYPE OF UNDERLYING: Obligatoryjne, jedno z listy:
 - COMM1 - Commodity: Single commodity
 - COMM2 - Commodity: Single commodity futures contract
 - COMM3 - Commodity: Basket of commodities
 - COMM4 - Commodity: Commodity index
 - COMM5 - Commodity: Commodity index futures contracts
 - COMM6 - Commodity: Other
 - CRDT - Credit
 - CURRE1 - Currency: Single currency
 - CURRE2 - Currency: Single currency futures contract
 - CURRE3 - Currency: Basket of currencies
 - CURRE4 - Currency: Other
 - EQU11 - Equity: Single Stock
 - EQU12 - Single stock futures contract
 - EQU13 - Equity: Basket of stocks
 - EQU14 - Equity: Equity index
 - EQU15 - Equity: Equity index futures contracts
 - EQU16 - Equity: Basket of equity Indices
 - EQU17 - Equity: Other
 - INTR1 - Interest rate: Single bond
 - INTR2 - Interest rate: Basket of bonds
 - INTR3 - Interest rate: Bond index
 - INTR4 - Interest rate: Bond index futures contracts
 - INTR5 - Interest rate: Reference rate (WIBOR, LIBOR, etc.)
 - INTR6 - Interest rate: Reference rate futures contract
 - INTR7 - Interest rate: Inflation rate
 - INTR8 - Interest rate: Other
 - EMAL - Emission allowances;

- UNDERLYING ISIN: Fakultatywne, alfanumeryczne, 12 znaków;
- UNDERLYING NAME: Obligatoryjne, tekst, 250 znaków;
- RIC CODE OF UNDERLYING: Fakultatywne, alfanumeryczne, 20 znaków;
- EXERCISE TYPE: Fakultatywne, "E" dla europejskiego, "A" dla amerykańskiego (puste w przypadku produktów innych niż warranty);
- MARKET EXPECTATION: Obligatoryjne, jedno z listy: LONG, SHORT, SIDEWAYS, tylko dla warrantów: CALL, PUT;
- SETTLEMENT TYPE: Obligatoryjne, jedno z listy: CASH, PHYSICALLY;
- BONUS LEVEL: Obligatoryjne tylko dla certyfikatów bonusowych, liczba/procent, 10,6;
- COUPON: Fakultatywne, procent, 5 znaków;
- CURRENCY RISK HEDGE: Obligatoryjne, YES lub NO;
- LEVERAGE: Obligatoryjne, YES lub NO;
- MULTIPLIER: Fakultatywne, liczba, 10,6, liczba instrumentów bazowych na 1 produkt, tj. ułamek instrumentu bazowego na produkt. Jeśli cena trackera jest 10 razy niższa niż cena instrumentu bazowego – mnożnik będzie wynosił 0,1;
- PROTECTION LEVEL: Fakultatywne, procent, 10,6; (wprowadzana wyłącznie wartość, bez znaku %, wprowadzenie wartości 100 rozumiane jako 100% - pełna ochrona, wprowadzenie wartości 50 rozumiane jako częściowa ochrona 50%);
- STRIKE CURRENCY: Fakultatywne, 3 znaki;
- STRIKE PRICE: Fakultatywne, liczba, 10 znaków;
- TRADING CURRENCY: Obligatoryjne, 3 znaki, jeden z listy: PLN, EUR;
- LIQUIDITY PROVIDER CODE 1: Obligatoryjne, do 5 znaków, nr animatora rynku przydzielany przez GPW;
- PROSPECTUS DATE: Obligatoryjne, data zatwierdzenia prospektu, YYYY-MM-DD, data: nie późniejsza niż dzień wprowadzenia danych;

- FINAL TERMS DATE: Fakultatywne, YYYY-MM-DD;
- FINAL TERMS NUMBER: Fakultatywne, 10 znaków;
- LINK TO PROSPECTUS: Obligatoryjne, URL, wyłącznie domeny zgłoszone do GPW;
- LINK TO FINAL TERMS: Obligatoryjne, URL, wyłącznie domeny zgłoszone do GPW;
- LINK TO PRODUCT WEBSITE: Fakultatywne, URL;
- KID URL adress: Obligatoryjne, URL, wyłącznie domeny zgłoszone do GPW;
- KID risk indicator: Obligatoryjne; 1-7;
- KID recommended holding period: Obligatoryjne; DXX (dni, XX – liczby 01-99) lub MXX (miesiące, XX – liczby 01-99) lub YXX (lata, XX – liczby 01-99).