



Központi
Elszámolóház
és Értéktár
(Budapest) Zrt.

Ügyféltájékoztató

Az EMIR-ben meghatározott derivatív ügyletek jelentési kötelezettségéről IV.

2013. december 18.



TISZTELT ÜGYFELEINK!

Ezúton szeretnénk tájékoztatni Önöket az EMIR-ben meghatározott derivatív ügyletek kereskedési adattárak (Trade Repository-TR) felé történő jelentésének kötelezettségével kapcsolatos aktuális információkról.

1. AKTUALITÁSOK

A KELER Igazgatósága novemberi ülésén jóváhagyta, **hogy a KELER mint adatközvetítő a Luxembourgban bejegyzett Regis-TR–ral, a Clearstream és az Iberclear által közösen tulajdonolt európai kereskedési adattárral kössön szerződést** az EMIR-ben meghatározott derivatív ügyletek jelentési kötelezettségének teljesítésében való közreműködés érdekében. A kiválasztott kereskedési adattár minden eszközosztályra vonatkozóan fogadja mind a tőzsdei (ETD), mind a tőzsdén kívüli (OTC) ügyleteket tartalmazó jelentéseket.

Az EMIR-ben meghatározott jelentési kötelezettség teljesítése érdekében a KELER Csoport az alábbi szolgáltatásokat nyújtja a vele szerződést kötő ügyfelek számára:

- A KELER felé minden eszközosztályra vonatkozó derivatív ügylet jelentésre kerülhet, függetlenül attól, hogy tőzsdei vagy tőzsdén kívüli ügyletről van szó;
- A KELER KSZF az általa garantált piacok esetében (BÉT derivatív, CEEGEX derivatív) automatikusan és díjmentesen jelenti az ügyleteket a klíringtagok nevében is (egyetlen feltétel, hogy a klíringtagnak a KELER-rel legyen szerződése az adatközvetítői szolgáltatásra vonatkozóan);
- A KELER KSZF az általa garantált piacok esetében megképzzi az ügyletek jelentéséhez szükséges egyedi ügyletazonosítókat (UTI);
- A KELER KSZF klíringtagként, az ECC által elszámolt piacok esetében, automatikusan és díjmentesen jelenti az ügyleteket az alklíringtagok nevében is (egyetlen feltétel, hogy az alklíringtagnak a KELER-rel legyen szerződése a adatközvetítői szolgáltatásra vonatkozóan);
- A KELER KSZF az általa garantált piacok esetében a klíringtag kérésére – külön díj ellenében – előállítja a klíringtag és megbízója közötti ügyletek jelentéséhez szükséges kivonatot.

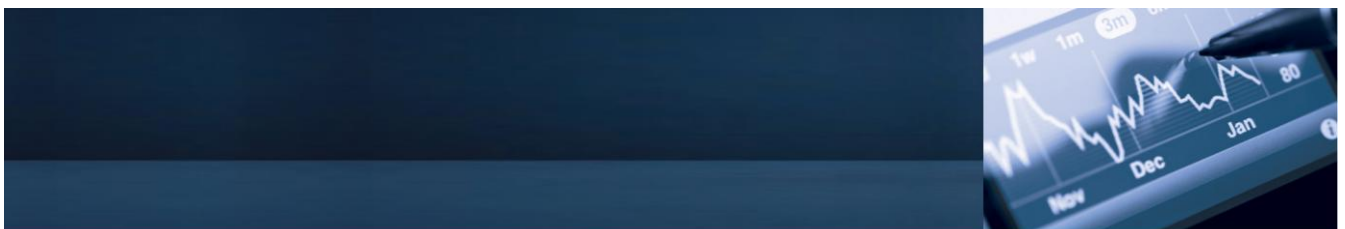
2. JELENTÉSEKSEL KAPCSOLATOS INFORMÁCIÓK

EGYEDI AZONOSÍTÓK HASZNÁLATA

LEI CODE – LEGAL ENTITY IDENTIFIER

Az Ügyfél azonosítására szolgáló, az EMIR 9. cikke szerinti jelentési kötelezettség teljesítéséhez alkalmazott alfanumerikus kód. LEI kód igényelni az ilyen engedéllyel rendelkező, jóváhagyott kiadóktól lehet. A jóváhagyott LEI kód kiadók listája az alábbi linken érhető el:

http://www.leiroc.org/publications/gls/lou_20131003_2.pdf



Az új ügyletek jelentése során ez az azonosító kötelezően használandó a szerződő felek azonosítására. A kereskedési adattárak ezt minden esetben ellenőrzik, és csak azon jelentéseket fogadják be, ahol mindkét fél esetében a LEI kód feltüntetésre került. (E szabály alól egyedül a magánszemélyek jelentenek kivételt, mivel az ő esetükben az adott szolgáltatónál meglévő ügyfélkód feltüntetésével lehet jelenteni.)

Amennyiben az ügyletben résztvevő két fél közül az egyik nem rendelkezik LEI kóddal, emiatt a másik fél sem tudja teljesíteni a jelentési kötelezettségét, mivel a saját nevében történő jelentés esetében is fel kell tüntetni a partner LEI kódját. Erre tekintettel minden szereplő esetében átgondolandó, hogy esetlegesen már az ügyletkötést is a LEI kód meglétéhez kössék. Amennyiben az ügyletet megkötni szándékozó felek így járnak el, ezzel biztosítják, hogy mindkét fél megfelelően eleget tudjon tenni a saját jelentési kötelezettségének.

UTI – UNIQUE TRADE IDENTIFIER

Az EMIR 9. cikke szerinti jelentési kötelezettség teljesítése során a KELER KSZF által generált, a kötések/ügyletek azonosítására szolgáló alfanumerikus kód. A KELER KSZF által garantált tőzsdei ügyletek esetében a KELER KSZF megképzeti a teljes ügyletkötési lánc lejelentéséhez szükséges ügyletazonosítókat (a megbízó és klíringtagok, valamint a klíringtagok és KSZF közötti ügyletekre vonatkozóan összesen 4 db UTI szükséges egy tőzsdei ügylet lejelentése során – lásd a fenti ábrát.) A UTI képzés analitikája is nyilvánosan elérhető lesz.

Minta a KELER KSZF által megképzendő UTI-ok felépítésére:

- 1-10. karakter: „000KCCP000”
- 11. karakter: B / S (vétel / eladás) a klíringtag szempontjából
- 12-19 karakter: klíringdátum (YYYYMMDD)
- 20-29. karakter: BÉT KERTAGAZON előnullázva
- 30. karakter: számlatípus: P (saját számlás), O (összevont megbízói), S (szegregált megbízó)
- 31-44. karakter: BÉT kötés azonosító
- 45. karakter: „C” karakter (CCP-CM láb), „A” karakter (CM-NCM/AGENT láb)

ITI – INTERIM TRADE IDENTIFIER

Az ETD ügyletekhez hasonlóan az OTC ügyletek esetében is a felek felelőssége, hogy az ügyletkötés során megegyezzenek a közös ügyletazonosítóban. Mivel várhatóan ez nem minden esetben tud megtörténni legkésőbb az ügyletkötést követő napon, ezért a kiválasztott kereskedési adattár bevezetett egy új mezőt az Interim Trade Identifier-t (ITI) annak érdekében, hogy a jelentési kötelezettségnek a felek minden esetben eleget tudjanak tenni.

Az új mező lehetővé teszi, hogy a felek részéről szabadon megadható ügyletazonosítóval az ügylet jelentésére sor kerüljön. Amennyiben az ügylet a felek részéről az ITI azonosítóval kerül jelentésre, akkor a UTI mezőt üresen kell hagyni. Ha egy új ügylet jelentése során mindkét mezőben van érték (UTI és ITI is) akkor a jelentést a kereskedési adattár visszautasítja.

Az átmeneti ügyletazonosítóval (ITI) jelentett ügylet esetében a későbbiekben szükséges a felek által megállapított UTI jelentése.



Ezt az ügylet módosításaként kell jelenteni és ebben az esetben a UTI mezőbe kell beírni a közös azonosított valamint az ITI mezőben fel kell tüntetni a korábban megadott azonosítót, amivel az ügylet lejelentésre került. A fenti főszabály alól ez az egy eset képez kivételt, ekkor mindkét mezőben (UTI, ITI) is szerepel érték.

Arra vonatkozóan a KELER nem rendelkezik információval, hogy az ITI azonosítóval jelentett ügylet esetében mennyi idő áll rendelkezésre a végleges UTI leadására.

KELER FELÉ KÜLDHETŐ JELENTÉSEK

A KELER Trade Reporting rendszerében az alábbi üzenettípusok kerültek megkülönböztetésre:

- Reported Trade (RT);
- Backloading (BL);
- Modification (MO);
- Valuation Update (VU);
- Collateral Update (CU);
- Trade Termination (TT);
- Trade Compression (TZ);
- TradeReport Cancellation (TC)

Az egyes riportok tartalma a 2013. szeptember 10. napján kiadott ügyféltájékoztatóban részletesen szerepel - a tájékoztató a KELER honlapján elérhető az alábbi linkre kattintva: <http://www.keler.hu/keler/keler.head.page?nodeid=2118>.

Változás a korábbiakhoz képest, hogy az üzenettípusok közül kikerült a Full Termination (FT) riport, melyet az ügylet korábban jelentett lejáratú időpontjában történő megszűnésekor kellett volna megküldeni. Mivel ez az üzenettípus törlésre kerül, így az ügylet jelentett időpont szerinti megszűnése esetén nem kell külön az ügylet törlésére vonatkozó üzenetet küldeni. Amennyiben az ügylet zárására a korábban jelentett időponttól eltérő időpontban kerül sor, akkor azt továbbra is jelenteni kell (Trade Termination) - lásd ESMA Q&A TR Question 12.

További változás, hogy egy új riport a „Collateral Update” került bevezetésre, melynek kapcsán az ügylet mögötti fedezetet érintő változásokat kell jelenteni (1. tábla 24-26 mezőinek változása esetén).

Az ESMA által rendszeresen frissített Q&A „munkaanyag” kereskedési adattárakra vonatkozó fejezetében foglaltak alapján (TR Question 3/b pont) a „collateral” és „valuation update” riportok megküldése nem kötelező a jelentés kezdő időpontjában, azokat elegendő 180 nappal az indulást követően jelenteni.

Ez jelentős könnyítés, hiszen így induláskor napi szinten elegendő az új ügyleteket jelenteni, és az ügyletek napi ártértékelését (napi árfolyam-különbözetek elszámolását) vagy a fedezetek módosulásának változását elegendő csak 180 nappal a jelentés kezdőidőpontját követően jelenteni – ezzel jelentősen csökken az indulást követően küldendő jelentések száma.

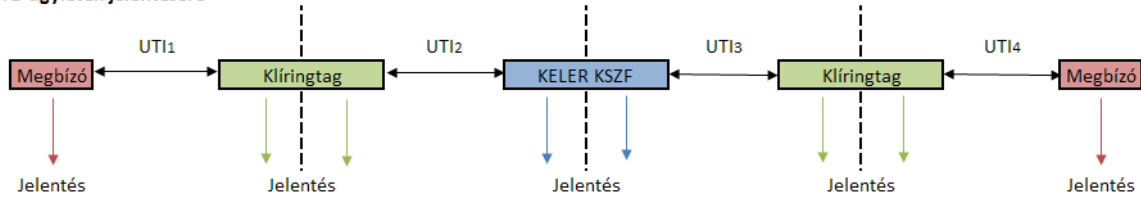


3. KELER CSOPORT SZOLGÁLTATÁSAINAK BEMUTATÁSA

KELER KSZF ÁLTAL GARANTÁLT ÜGYLETEK JELENTÉSE (BÉT DERIVATÍV ÉS A CEEGEX DERIVATÍV ÜGYLETEK)

A KELER KSZF által garantált tőzsdei ügyletek esetében a KELER KSZF generálja a UTI kódokat a később leírt algoritmus alapján. Az ügyletkötési/jelentési lánc az alábbiak szerint alakul:

Minta ETD ügyletek jelentésére

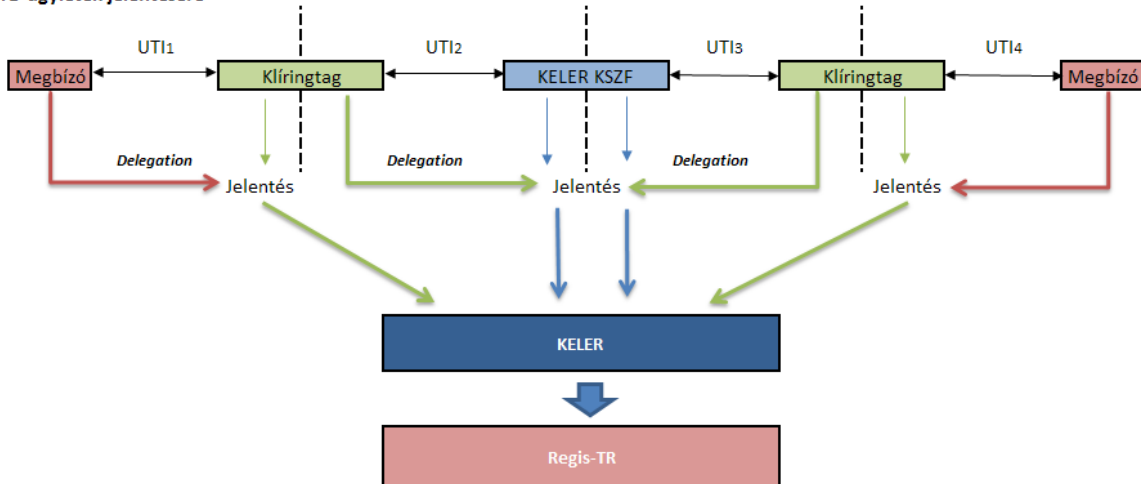


A megbízó esetében feltételeztük, hogy jogi személyről van szó, hiszen magánszemélyeket nem terheli jelentési kötelezettség, de a klíringtagoknak ebben az esetben is jelenteniük kell a saját nevükben, a magánszemélyt pedig partnerként fel kell tüntetniük (annak ügyfélkódjával).

A fent ábra azt az esetet mutatja be, amikor minden szereplő a maga nevében jelenti le az ügyleteket, azaz egyik fél sem delegálja a jelentést.

A gyakorlatban azonban azt a megoldást tartjuk gyakoribbnak, hogy az ügyfelek/megbízók nevében a klíringtagok, míg a KELER KSZF és a klíringtag közötti ügyletet, a KELER KSZF fogja jelenteni, az alábbiak szerint:

Minta ETD ügyletek jelentésére



A KELER KSZF által garantált piacok esetében a KELER KSZF automatikusan jelenti az ügyletek adatait a klíringtagok nevében, ez részét képezi a klíringszolgáltatásnak. Ebből kifolyólag a klíringtag és a KELER KSZF között létrejövő ügyletek esetében a klíringtagnak – ha a közte és a KELER KSZF között létrejövő megállapodásában, vagy már létrejött szerződések esetében az külön nyilatkozatban másként nem rendelkezik – nincs dolga az ügylet saját oldalának lejelentésével.



Azon klíringtagok, akik nem kívánnak élni a KELER KSZF által biztosított lehetőséggel, és inkább a saját nevükben kívánnak jelenteni, ezt a KELER KSZF-fel létrejövő megállapodásban illetve a már létrejött megállapodások esetén egy külön nyilatkozatban (a KELER KSZF által rendszeresített nyilatkozat-sablonon) jelezniük kell a KELER KSZF felé.

A klíringtag és a KELER KSZF közötti ügylet KELER KSZF általi jelentése díjmentes, azért jelentési és nyilvántartási díjat a KELER KSZF és a KELER sem számít fel. A jelentési kötelezettség fenti módon történő átvállalásának feltétele, hogy a klíringtag a KELER-nél általános vagy egyéni tagsággal rendelkezzen az adatközvetítői (trade reporting) szolgáltatás kapcsán. A KELER KSZF által a klíringtag nevében jelentett ügyleteket a klíringtagok a KELER által üzemeltetett „Trade Reporting” rendszerében meg tudják tekinteni, annak státuszáról információkat fognak kapni.

A tőzsdei ügyletek esetében az ügyletkötési lánc részét képezik a megbízók és klíringtagok közötti ügyletek, amelyeknek a KELER KSZF-en keresztül történő jelentésére nincs lehetőség, mivel ezen ügyleteknek a KELER KSZF nem résztvevője.

Annak érdekében, hogy a KELER KSZF klíringtagok – közöttük és a megbízók/ügyfelek közötti ügyletek vonatkozásában fennálló – jelentési kötelezettségét mégis elő tudja segíteni, a KELER KSZF a klíringszolgáltatáshoz kapcsolódó új kivonatot vezet be. Az új kivonat a nap végén megküldésre kerül a klíringtagok számára (CSV formátumban) és tartalmazza az adott klíringtag és az ügyfelei közötti ügyleteket. Az új kivonat a KID rendszeren keresztül lesz elérhető az ezt igénylő klíringtagok számára.

A kivonat felépítése megegyezik az ügyletek lejelentése során a KELER által használt üzenetek felépítésével, így a KELER KSZF által megküldött „kivonat” változtatás nélkül továbbküldhető a KELER felé, így alkalmas az EMIR-ben előírt jelentési kötelezettség teljesítésére.

A kivonat előállításáért a KELER KSZF díjat számol fel. A díj a megküldött kivonatban szereplő UTI-okként 4 Ft+ÁFA. Ily módon, ha egy adott napon a klíringtag és megbízói között összesen 500 db ügylet jött létre, akkor a kivonat kapcsán a KELER KSZF összesen 2 000 Ft+ÁFA-t fog felszámolni.

A kapott kivonat, mint jelentés KELER felé történő továbbítása esetén (a klíringtag/megbízó és a KELER között létrejött megállapodás alapján) a KELER a jelentési és hónap végével a nyilvántartási díjat felszámítja.

Annak érdekében, hogy a fent említett kivonat a jogszabályi előírásoknak megfeleljen, szerepeltetni kell rajta a klíringtag saját adatai mellett az ügyfelei/megbízói adatait is (pl.: a megbízó LEI kódja). Ezen adatokat a klíringtagnak külön be kell jelentenie a KELER KSZF felé, amelyre szintén a KID rendszeren keresztül lesz lehetősége. A KELER a jelentési rendszer indulásakor egy „tömeges” adatfeltöltést tervez, melynek során a KELER KSZF által megküldött excel sablon kitöltésével lehetőség lesz klíringtagonként az érintett ügyfelek és megbízók adatainak megadására.

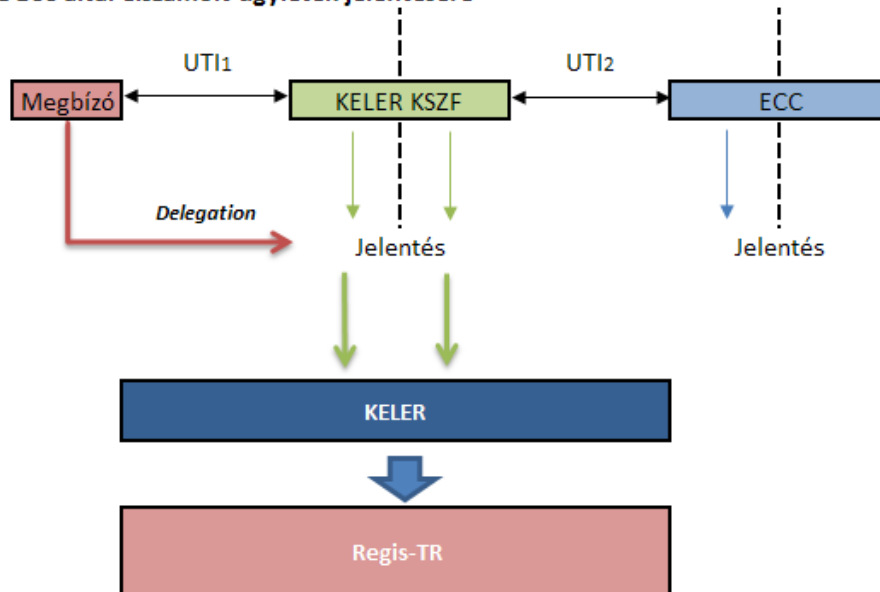


Amennyiben a klíringtag a megbízó LEI kódját nem jelentette be a KELER KSZF felé, úgy az adott mezőt a kivonaton a KELER KSZF üresen hagyja. Fontos megjegyezni, hogy a Regis-TR és így a KELER sem fogad be LEI nélküli jelentést, tehát ebben az esetben a klíringtag kötelessége pótolni azt.

A KELER KSZF-EN MINT KLÍRINGTAGON KERESZTÜL ELSZÁMOLT ÜGYLETEK JELENTÉSE (ECC ÁLTAL GARANTÁLT DERIVATÍV ÜGYLETEK)

Az European Commodity Clearing (ECC) által garantált piacok esetében a KELER KSZF mint klíringtag vesz részt az ügyletek elszámolásában. Ebben a szerepében is automatikusan jelenti az ügyleteket az ügyletben résztvevő másik fél (alklíringtag) nevében is, amennyiben erről az ügyfél máshogy nem rendelkezik.

Minta az ECC által elszámolt ügyletek jelentésére



A megbízói oldal KELER KSZF által történő jelentése díjmentes, azaz sem a KELER KSZF sem a KELER részéről jelentési vagy nyilvántartási díj nem kerül felszámításra a megbízóval (alklíringtag) szemben. A megbízó nevében történő jelentés egyetlen feltétele, hogy a megbízó a KELER-nél általános vagy egyéni tagsággal rendelkezzen a KELER adatközvetítői szolgáltatásához kapcsolódóan.

A HUPX-en kötött derivatív ügyletek kivételével az ECC képi az ügylet lejelentéséhez szükséges UTI azonosítókat.

A HUPX ügyletek esetében az ECC által használt metódust felhasználva a KELER KSZF állítja elő a UTI-t.

BACKLOADING (VISSZAMENŐLEGES) JELENTÉS

Az EMIR előírása, hogy a jelentési kötelezettség indulásától kezdve (2014. február 12.) a korábban, az alábbiak szerinti időintervallumokban kötött ügyletek is lejelentésre kerüljenek.



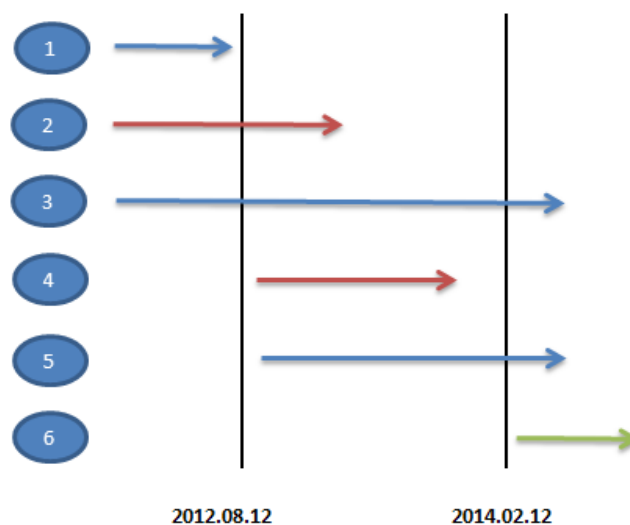
A korábbi ügyletek lejelentése kapcsán két fontos határidőt kell figyelembe venni: az EMIR hatályba lépésének napja (2012. augusztus 16.) valamint a jelentési kötelezettség kezdő időpontja (2014. február 12.).

A visszamenőleges jelentések meghatározásakor az EMIR alapján az alábbi két esetet különböztetjük meg:

1. azon ügyleteket, amelyek az EMIR hatálybalépésekor már léteztek és a jelentési kötelezettség kezdő időpontjában még mindig léteznek 90 napon belül kell jelenteni egy kereskedési adattár felé.
2. azon ügyleteket, amelyek az EMIR hatálybalépésekor már léteztek vagy azt követően kerültek megkötésre, de már nem léteztek a jelentési kötelezettség kezdő időpontjában, azokat 3 éven belül kell jelenteni egy kereskedési adattár felé.

A visszamenőleges jelentések kapcsán lehetséges esetek az alábbi ábrán kerültek összefoglalásra:

Backloading kötelezettség



- 1) Nem érintett az EMIR jelentési kötelezettség kapcsán
- 2) A jelentés kezdő időpontjától számított 3 éven belül kell jelenteni
- 3) A jelentés kezdő időpontjától számított 90 napon belül
- 4) A jelentés kezdő időpontjától számított 3 éven belül kell jelenteni
- 5) A jelentés kezdő időpontjától számított 90 napon belül
- 6) Ügyletkötést követő napig (T+1)

A Backloading jelentési kötelezettség kapcsán fontos kiemelni, hogy a KELER által kiválasztott kereskedési adattár díjmentesen biztosítja az ügyletek ESMA felé történő bejelentését, amennyiben arra a jelentési kötelezettség kezdő időpontja előtt kerül sor. Azaz amennyiben a Backloading kötelezettség kapcsán az érintett ügyletek jelentése 2014. február 12-ig megtörténik, akkor ennek kapcsán sem jelentési sem nyilvántartási díj nem kerül felszámításra. Természetesen az így lejelentett és még élő ügyletek esetében a jelentés kezdő időpontját követően a nyilvántartási díj már fizetendő.



A fentiek alapján 2014. január végétől egészen február 11-ig lehetőséget biztosítunk az ügyletek visszamenőleges jelentésére annak érdekében, hogy a díjmentes időszak kihasználható legyen.

A Budapesti Értéktőzsdén kötött derivatív ügyleteket a KELER KSZF visszamenőlegesen jelenti, a jelentési kötelezettség kezdő időpontjáig. Ahogy a napi ügyletek esetében, a visszamenőlegesen jelentendő ügyletek esetében is a KELER KSZF nemcsak a saját oldalát, hanem az ügylet másik oldalán lévő klíringtag nevében is automatikusan jelenti az ügyletet, kivéve, ha a klíringtag külön nyilatkozik arról, hogy ezt nem kéri.

A tőzsdei ügyletek esetében, az ESMA által kiadott Q&A-ben szereplők szerint az ügylet utolsó állapota kerül csak jelentésre.

A KELER KSZF az ezt külön igénylő klíringtagok számára a napi jelentésekhez hasonlóan előállítja a klíringtag és a megbízója közötti ügyletek visszamenőleges jelentéséhez szükséges kivonatokat.

Annak érdekében, hogy a KELER KSZF a szükséges kivonatot elő tudja állítani, a klíringtagok előzetesen meg adják a partnerekre vonatkozó adatokat (pl. LEI kód).

Ezen kivonatok előállításáért a napi ügyletek kapcsán felszámítottakkal megegyezően 4+ÁFA/ kötési díj kerül felszámításra.

A fentiek alapján a KELER KSZF az általa garantált tőzsdei ügyletek visszamenőleges jelentése esetén automatikusan jelenti a KELER KSZF és a klíringtag közötti ügyleteket (ha a klíringtag erről másként nem nyilatkozik) valamint előállítja és a KID rendszeren keresztül elérhetővé teszi az ezt igénylő klíringtagok számára a klíringtag és megbízója közötti ügyleteket.

Visszamenőleges jelentések esetén, ahol lehetséges, az egyedi azonosítók használata szükséges (LEI, UTI kódok).

4. A KELER ADATKÖZVETÍTŐI SZOLGÁLTATÁSÁHOZ KAPCSOLÓDÓ DÍJAK

A KELER az adatközvetítői szolgáltatás nyújtása során az alábbi díjakat számolja fel a vele szerződést kötő ügyfelek felé:

- a) *Tagsági díj;*
- b) *Jelentési díj;*
- c) *Nyilvántartási díj.*

Általánosságban elmondható, hogy a KELER a Regis-TR-hoz képest kedvezőbb tagsági díjat, míg a jelentési és nyilvántartási díjak esetében a Regis-TR díjaival megegyező díjat számít fel a vele szerződést kötő ügyfelekkel szemben. Ezzel biztosítja azt, hogy a KELER-rel szerződést kötő ügyfelek összességében kevesebb díjat fizessenek az EMIR-ben előírt jelentési kötelezettség teljesítése kapcsán, mintha közvetlenül csatlakoztak volna a kiválasztott kereskedési adattárhoz.



TAGSÁGI DÍJ

A KELER a választott tagsági forma alapján az alábbi tagsági díjakat számolja fel:

Tagsági díjak			
Általános tagsági díj	havi	80 000	Ft+ÁFA
Egyéni tagsági díj	havi	40 000	Ft+ÁFA
Indirekt tagsági díj	havi	10 000	Ft+ÁFA

Általános tagsági díjat a KELER azon ügyfelek esetében számítja fel, akik mind a saját mind az általuk kötött ügyletben résztvevő másik fél nevében küldenek jelentést a KELER felé;

Egyéni tagsági díjat a KELER azon ügyfelek esetében számítja fel, akik csak a saját nevükben küldenek jelentést a KELER felé;

Indirekt tagsági díjat a KELER az Általános tag azon ügyfelei esetében számítja fel, akik közvetlenül nem jelentenek a KELER felé, azonban nyomon szeretnék követni, hogy a nevükben milyen ügyletek kerültek lejelentésre (azaz számukra a KELER csak lekérdezési jogkörrel bír).

JELENTÉSI DÍJ

A jelentési díj a következők szerint kerül felszámításra:

Jelentési díj (riport/db)			
Jelentési díj (ETD+OTC)	riportonként	6	Ft+ÁFA

A jelentési díj esetén nincs különbség, hogy OTC vagy ETD (tőzsdei) ügylet bejelentésére kerül sor.

A jelentési díjat a KELER egy ügylet kapcsán csak egyszer számítja fel (UTI-onként), az ügylet első jelentésekor (csak trade reporting vagy backloading jelentéseknél). Az ügylet kapcsán küldött további riportok (pl: „modification”, „valuation és collateral update”) esetében jelentési díj felszámítására ismételten már nem kerül sor.

Amennyiben egy ügylet kapcsán az ügyletben résztvevő mindkét fél egyszerre, egy üzenetben teljesíti jelentési kötelezettségét, a jelentési díj akkor is csak (UTI-onként) egyszer kerül felszámításra.

Egy üzenetben (CSV vagy XML) több ügylet jelentése is megtörténhet, ebben az esetben a jelentési díjat a KELER az üzenetben szereplő UTI-ok száma alapján határozza meg.

Az ügyfél által hibásan (rossz adatokkal) jelentett ügyletek napon belüli törlése esetén jelentési díj nem kerül felszámításra.



NYILVÁNTARTÁSI DÍJ

A nyilvántartási díj a lejelentett és adott hónapban élő (nyitott) ügyletek kapcsán, havi szinten az alábbiak szerint kerül felszámításra.

Nyilvántartási díj (élő ügylet/hó)			
Nyilvántartási díj	nyitott ügyletenként	10	Ft+ÁFA

A nyilvántartási díj szempontjából nem bír jelentőséggel, hogy az adott ügylet egész hónapban vagy csak a hónap egy részében „létezett”.

A napon belül törölt ügyletek esetében nyilvántartási díj nem kerül felszámításra.

Példa a díjak számítására

Az ügyfél az adott hónapban az alábbi ügyleteket jelenti a KELER-en keresztül a kereskedési adattár felé:

- ETD ügyletek száma: 3 000 db
- OTC ügyletek száma: 2 000 db

Összesen: 5 000 db ügylet. (A KELER-hez továbbított adatok szerint az ügyletek között mind saját mind megbízási ügyletek is előfordulnak.)

Díjszámítás:

KELER általános tagsági díj: 80 000 Ft

Jelentési díj:

- ETD ügyletek esetében: 3 000 db* 6 Ft = 18 000 Ft
- OTC ügyletek esetében: 2 000 db* 6 Ft = 12 000 Ft

Nyilvántartási díj (havi):

- ETD ügyletek esetében: 3000 db*10 Ft = 30 000 Ft
- OTC ügyletek esetében: 2000 db*10 Ft = 20 000 Ft

Összesen fizetendő: 80 000 Ft+ 18 000 Ft+ 12 000 Ft+ 30 000 Ft+ 20 000 Ft= 160 000 Ft+ÁFA

Ez az ár már tartalmazza az ügyfél/megbízó nevében lejelentett ügyleteket is.

5. TOVÁBBI LÉPÉSEK

TESZTELÉS

Januárban a KELER újabb tesztidőszakot indít, annak érdekében, hogy a teljes jelentési folyamat (Ügyfelek – KELER – Regis TR) tesztelésre kerülhessen.

A tervezett tesztidőszak: 2014. január 6. – 2014. január 24.

A szükséges fejlesztések lezárását követően a tesztelés során az ügyfelek nevében a KELER KSZF által jelentett tőzsdei ügyletek is megtekinthetőek lesznek a KELER Trade Reporting rendszerében.



Az ügyletek jelentése érdekében korábban megküldésre került a webes szolgáltatáshoz szükséges IT specifikáció (WSDL-XSD jelek), melyekben némi változtatást kellett végezni, lekövetve a Regis-TR által végzett módosításokat. A KELER az új, módosított WSDL-XSD csomagot automatikusan megküldi az eddig tesztelő partnereknek, illetve az ezt igénylő új ügyfeleknek is.

A Regis-TR jelzése alapján a jelentések felépítésében, struktúrájában történt mostani módosításokon kívül, a jelentési kötelezettség kezdő időpontjáig már nem terveznek újabb módosításokat, illetve esetleges módosítás esetén a most véglegesített üzenetstruktúra is befogadható lesz.

A fentiek alapján így a KELER által véglegesített és megküldendő IT specifikáció már várhatóan véglegesnek tekinthető és a jelentés kezdő időpontjáig ebben már nem lesznek változások.

A januári tesztidőszakra vonatkozó részletes tesztforgatókönyv még december folyamán elérhető lesz a partnerek számára.

Tesztre jelentkezni a tradereporting@keler.hu e-mail címen keresztül lehetséges. A tesztre már korábban regisztrált partnereknek ismételtelen nem kell regisztrálniuk magukat.

SZERZŐDÉSEK

A KELER és a kiválasztott kereskedési adattár részéről folyamatban van a szolgáltatás igénybevételéhez szükséges szerződések aláírása, melynek lezárását követően lesz lehetőség a KELER és ügyfelek közötti szerződések megkötésére.

A KELER és a KELER KSZF részéről elkészültek a szolgáltatás igénybevételéhez szükséges szerződések, amelyek a partnereink rendelkezésére állnak.

A KELER-nél jelenleg is számlával rendelkező ügyfeleknek csak egy szerződés kiegészítést kell aláírniuk annak érdekében, hogy igénybe tudják venni a KELER szolgáltatását.

Amennyiben igénylik, hogy a KELER KSZF jelentse az általuk kötött ügyleteket (klíringtag és KELER KSZF viszonylatában), akkor ehhez nem kell semmit tenniük, hiszen ez részét képezi a klíringszolgáltatásnak, így nyilatkozni csak abban az esetben szükséges, ha ezt nem szeretnék igénybe venni (e tekintetben a KELER KSZF a partner rendelkezésére bocsátja a szükséges formanyomtatványt).

Azon klíringtagok pedig, aki igénybe kívánják venni a KELER KSZF által készített új, a megbízók és klíringtagok közötti ügyletek adatait tartalmazó kivonatot akkor ezt szintén egy külön nyilatkozat kitöltésével kérhetik.

A KELER-rel szerződéses kapcsolatban még nem álló partnerek esetében a fent említett szerződés kiegészítés mellé a partner 3 hónapnál nem régebbi cégkivonatára és a szerződést aláíró képviselőre jogosult személyek aláírási címpéldányra lesz szükség.



A KELER és a KELER KSZF decemberi Igazgatósági ülése alkalmával mind a KELER, mind a KELER KSZF Általános Üzletszabályzata és Díjszabályzata elfogadásra került, melyek az EMIR által előírt jelentési kötelezettség kapcsán nyújtandó szolgáltatásokra vonatkozó szabályokat és információkat tartalmazzák.

A KELER és a KELER KSZF honlapokon elérhetőek a felügyeleti jóváhagyásra megküldött szabályzatok.

Amennyiben további kérdésük merülne fel a fentiekkel kapcsolatban, kérjük, forduljanak bizalommal a KELER Csoport kollegáihoz az alábbi elérhetőségeken:

Csiszér Péter

Stratégiai és Ügyfélkapcsolati Igazgató

Tel: (+36 1) 483 – 6274

E-mail: csiszer.peter@keler.hu

Banadics Iván

osztályvezető

Stratégiai és Termékmenedzsment Osztály

Tel: (+36 1) 483 – 6284

E-mail: banadics.ivan@keler.hu

Szarka Gergely

termékmenedzser

Stratégia és Termékmenedzsment Osztály

Tel: (+36 1) 483 – 6213

E-mail: szarka.gergely@keler.hu

Nyíri Szabolcs

osztályvezető

Ügyfélkapcsolati és Marketing Osztály

Tel: (+36 1) 483 – 6187

E-mail: nyiri.szabolcs@keler.hu

Központi e-mail cím: tradereporting@keler.hu

Budapest, 2013. december 18.

