



Központi
Elszámolóház
és Értéktár
(Budapest) Zrt.

Ügyfél-tájékoztató

A KELER Trade Reporting rendszerébe feltöltendő jelentésállományok változásairól

2014. február 27.



Tisztelt Ügyfeleink!

Ezúton szeretnénk összefoglalni Önöknek az EMIR jelentésekben bekövetkező változásokat, melyek a kereskedési adattárral való összhang érdekében feltétlenül szükségesek voltak.

A jelen dokumentumban meghatározott változások várhatóan a 2014. február 28-án éjjel élesedő Trade Reporting verzióval kerülnek bevezetésre, illetve Ügyfeleink rendelkezésére bocsátott tesztkörnyezeten már jelenleg is a változásoknak megfelelő tételek tölthetők csak fel.

1. Életciklus üzenetek esetében a „counterpartyData” mezők ismételhetsége

Annak érdekében, hogy a „*delegation=Y*” típusú megbízotti jelentésekhez kapcsolódó Termination, Compression, Cancellation, Valuation update és Collateral update üzenetek is megfelelően feldolgozhatók legyenek, megismételhetővé tettük az ún. counterpartyData tag elemeit ezen üzenetekben. A jövőben, amennyiben az eredeti jelentés esetében a delegation mező értéke Y volt, vagyis mindkét fél nevében volt beküldve a jelentés, akkor a partyId, partyId és reportingEntityIdType, reportingEntityId mezők megisméltendők. Ebben az esetben az első partyId mezőbe a jelentést eredetileg is beküldő fél azonosítóját kell feltüntetni (aki a műveletet is kezdeményezi) és a másik partyId mezőbe a másik szerződő fél azonosítója kerül (akinek a nevében a jelentést beküldő partner eljár).

Ha az eredeti reportedTrade vagy Backloading jelentés esetében a „*delegation=N*” volt, akkor a partyID és a reportingEntityId nem megisméltendő és a partyId mező értéke az eredeti jelentést is beküldő fél azonosítója. Tehát a nem delegált jelentés esetén ezek az életciklus üzenetek változatlan formában feladhatók.

Amennyiben a jelentést beküldő partner a jelentést CSV formátumú jelentésként tölti fel a KELER Trade Reporting rendszerben, akkor a reportedTrade és Backloading típusú jelentésállományoknál is megszokott ismétlődő mezőkben adja meg a másik szerződő fél azonosítóját.

A reportingEntityIdType és reportingEntityId mező továbbra is minden esetben a BIC és KELRHUHBXXX értéket veszi fel.

2. A terminationDate mező kezelésének változásai

Többen jelezték felénk, hogy a reportedTrade típusú jelentés esetében zavaró a terminationDate mező, hiszen az érdeemben nem tölthető. Ennek megfelelően a reportedTrade típusú jelentések esetében a terminationDate mező megszüntetésre került. A korábban előállított jelentéssablonokhoz képest XML állomány esetében a terminationDate tag nem kerül bele az üzenetbe, illetve CSV formátumú jelentés esetén a mind a fejlécből, mind a jelentésállomány sorból törlésre kerül ez az „oszlop”. A már elkészített CSV formátumú jelentésekhez képest a változás szükségessé teszi a fejlécben a „terminationDate;” oszlop törlését, valamint a settlementDate mező értéket megelőző egyetlen „;” szeparátor törlését.



A terminationDate mező a továbbiakban csak a TradeTermination és TradeCompression üzenetek esetében kötelező, míg a TradeReportCancellation típusú üzenet esetében a továbbiakban ez nem feladandó mező.

XML formátumú betöltés esetén értelmezhető változás, hogy a terminationDate mező kikerült az életciklus üzenetek esetében a counterpartyData/commonTradeData/transactionDetails tag alól és az alábbi helyen elérhető: TradeTerminationRq/trade/terminationDate és TradeCompressionRq/trade/terminationDate

3. Az „executionTimestamp” mező kezelésének változásai az életciklus üzenetek esetében

Az executionTimestamp mező továbbiakban is kötelező a TradeTermination és TradeCompression esetén, de a továbbiakban csak opcionális a TradeReportCancellation esetén.

4. A frequency jellegű mezők lehetséges értékeinek változásai

A kereskedési adattár által megkövetelt lehetséges értékeknek megfelelően a mező értékében feltüntetendő 1 betű karakter értéke az alábbi lehet:

- D: Daily
- W: Weekly
- M: Monthly
- Q: Quarterly
- S: Semi-annually
- A: Annually
- T: Term

Az érintett mezők köre a következő:

- fixedLegPaymentFrequency,
- fixedLegPaymentFrequency2,
- floatingRatePaymentFrequency,
- floatingRatePaymentFrequency2,
- floatingRateResetFrequency,
- floatingRateResetFrequency2

5. A „countryOfParty” mező kötelezősége

A kereskedési adattár által felállított formai elvárásokhoz igazodva a countryOfParty mező a továbbiakban kötelező mező a ReportedTrade és Backloading üzenetek esetében.



6. Változások összefoglalása

JELENTÉS TÍPUSA	VÁLTOZÁS	TEENDŐ CSV ESETÉN	TEENDŐ XML ESETÉN
Reported Trade	„TerminationDate” mező megszűnt	A fejlécben és az adatsoron belül 1 pontosvessző törlendő a Maturity és Settlement date mezők között	Mezőt nem kell tölteni
Trade Cancellation, Compression, Termination, Valuation és Collateral Update	„Delegation=N” esetén nincs változás		TerminationDate tag áthelyezése a Trade tag alá
	„Delegation=Y” kitöltendő az „other counterparty” oldala is, akinek a nevében a jelentés szintén beküldésre került		
Trade Report Cancellation	„executionTimestamp” mező a jövőben opcionálisan töltendő		
Reported Trade és Backloading	„CountryofParty” mező kötelezően töltendő		

A feltüntetett változásoknak megfelelő WSDL-XSD állományokat és üzenetspecifikációs leírásokat tájékoztató csomagban juttatjuk el Ügyfeleink részére, illetve a CSV és XML formátumú mintaüzeneteket is hamarosan elküldjük.

Amennyiben a jelen dokumentumban összefoglalt változásokhoz kapcsolódóan további kérdése van, kérjük, jelezze felénk a servicedesk@keler.hu címen.

Budapest, 2014. február 27.

