

## Ügyféltájékoztató az EMIR-ben meghatározott derivatív ügyletek jelentési kötelezettségéről VII.

2014. július 20.

## Tartalomjegyzék

<b>„VALUATION” és „COLLATERAL UPDATE” JELENTÉSEK .....</b>	<b>3</b>
Collateral update (CU) riportok .....	4
Valuation riportok .....	9
<b>ESMA Q&amp;A .....</b>	<b>11</b>
<b>REGIS-TR ÁLTAL VÉGZETT FRISSÍTÉSEK, MÓDOSÍTÁSOK .....</b>	<b>13</b>
A jelentésben résztvevő felek azonosítójának (Party és Counterparty ID) módosítása .....	13
ID típus figyelmen kívül hagyása a „másik partnerre” (counterparty type) vonatkozó mezőben.....	14
Törlési „protokoll” módosulása .....	15
Pozíciók esetében a vevői és eladói oldal módosítása .....	15
Kereskedési hely (Venue) mező ellenőrzése .....	15
Jelentett ügyletek adatainak rekonziliációja.....	16
<b>KSZF ÁLTAL GENERÁLT RIPORTOKAT ÉRINTŐ VÁLTOZÁSOK .....</b>	<b>25</b>
Pozíciók jelentése a klíringtag és megbízója közötti ügyletek kapcsán .....	26
Valuation és Collateral update riportok .....	27
Jelentések automatikus feltöltése.....	27
Számlázás .....	29
<b>ÚJ FUNKCIÓK A FELÜLETEN .....</b>	<b>29</b>
Tranzakció monitoring.....	29
Jelentés monitoring.....	30
Ügylet monitoring .....	35

## TISZTELT ÜGYFELEINK

Ezúton szeretnénk tájékoztatni Önöket az EMIR-ben meghatározott derivatív ügyletek kereskedési adattárak (Trade Repository, a továbbiakban: TR) felé teljesítendő jelentési kötelezettségével kapcsolatos legfrissebb információkról

### **„VALUATION” ÉS „COLLATERAL UPDATE” JELENTÉSEK**

Az EMIR előírásainak megfelelően **2014. augusztus 11-től a pénzügyi szerződő feleknek** (Financial Counterparties, FCs) és az **EMIR elszámolási küszöbértékét meghaladó nem pénzügyi szerződő feleknek** (NFC+) jelenteniük kell a derivatív ügylethez kapcsolódó biztosítékokat és az ügyletek értékelését.

A **nem pénzügyi szerződő felek** (NFC-) viszont **nem kötelesek az ügyletek értékelését és biztosítékát** jelenteni.

Az értékelési információ (valuation) tájékoztat a partner kitettségének piaci értéken történő vagy modell szerinti értékeléséről. A „collateral update” (biztosítéki adatok frissítése) meghatározza a kitettség fedezetéül szolgáló eszközök értékét (legyen szó egyedi vagy akár portfólió alapon képzett biztosítékokról).

A biztosítékokban történő változások jelentésének célja, hogy az ESMA és az illetékes nemzeti hatóságok átfogó képpel rendelkezzenek az átadott biztosítékokról és a partner kitettségének összegéről.

**A napi értékelési adatok és a biztosítékokra vonatkozó információk a Trade Repository által nem kerülnek rekonziliálásra, a piaci szereplőknek ezeket az értékeket helyesen kell megadniuk.**

Mind az értékelésre, mind a biztosítékok változására vonatkozó üzenetek az EMIR technikai standardokban foglaltak alapján kerültek kialakításra.

Az új jelentésekkel kapcsolatos fontosabb tudnivalók az alábbi táblázatban kerültek összefoglalásra:

	<b>Collateral reports</b>	<b>Valuation reports</b>
Jelentésre kötelezett	FC NFC+	FC NFC+
Érintett ügyletek	A 2014. augusztus 11. után jelentendő ügyletek (nincs visszamenőleges jelentési kötelezettség)	
Határidő	Legkésőbb a biztosíték értékelését követő napon (T+1)	Legkésőbb az ügylet végrehajtását követő napon (T+1)
Gyakoriság	Napi	Napi
Jelentő fél	Biztosítékot nyújtó fél	Mindkét fél

A 2014. augusztus 11-én jelentendő ügyleteknek már tartalmazniuk kell a biztosítéki és értékelési információkat, míg az ezelőtt jelentett ügyletek esetében ezen információk megadása nem szükséges. Az ügyletben résztvevő mindkét fél köteles jelenteni az értékelési adatok frissítését, míg a biztosítéki adatok frissítését csak a biztosítékot nyújtó félnek kell jelentenie.

#### Collateral update (CU) riportok

Az EMIR szerint a biztosítéki adatok frissítését a biztosítékot nyújtó félnek a biztosíték értékelését követő napon (T+1), nap végig kell jelenteni.

Nem klíringelt OTC ügyleteknél az értéket kétoldalúan határozzák meg a felek és legkésőbb T+1 napon jelentik, amint az rendelkezésre áll. Ha az adat nem áll rendelkezésre időben, a korábban jelentett értéket kell figyelembe venni.

A CU üzeneteket naponta kell megküldeni az adattáraknak. Ha a legutóbb beadott jelentés óta a biztosíték értéke nem változott, az ügyfél jelentheti ugyanazt az értéket vagy dönthet úgy, hogy nem küld CU üzenetet, ebben az esetben a legutóbb jelentett értéket tekinti a rendszer az érvényes biztosítéki értéknek.

A biztosítéki adatok frissítésének jelentésére vonatkozó kötelezettség célja, hogy a szabályozók átlássák a kitétségeket és az ezekkel kapcsolatos piaci kockázatokat.

A CU jelentés a következő mezőket tartalmazza:

- biztosítékok;
- biztosítéki portfólió;
- biztosítéki portfólió kód- ha az ügylet portfólióhoz kapcsolódik, egyébként nem szükséges jelenteni;
- a biztosíték értéke;
- a biztosíték értékének devizaneme.

A biztosíték típusát vagy a mögöttes eszköz típusát nem kell megadni. A **több eszközt tartalmazó biztosítéki struktúrát készpénzre kell váltani és készpénz-ellenértékét kell jelenteni.**

A biztosítéki kategóriát a biztosítéki mezőben a következő értékek használatával kell megadni:

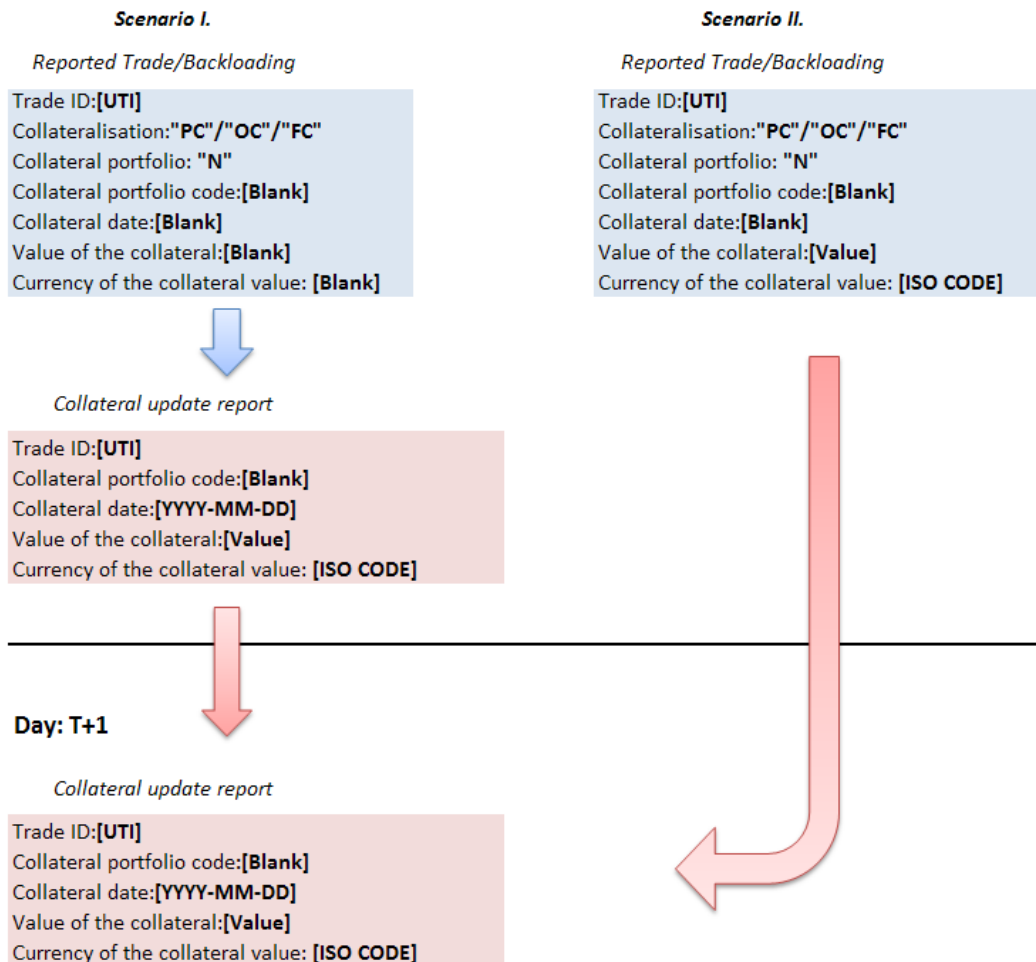
- U- biztosítékkal nem fedezett (uncollateralised);
- PC - részben biztosítékkal fedezett (partially collateralised);
- OC - egy irányban biztosítékkal fedezett (one way collateralised);
- FC - teljes mértékben biztosítékkal fedezett (fully collateralised).

Ezeknek az „indikátoroknak” a részletes meghatározására az ESMA Q&A anyagában is megtalálhatóak.

A biztosítékok jelentése kapcsán az alábbi szkenáriók lehetségesek:

## I. Biztosítékok ügyletenként kerülnek lejelentésre

Day:T



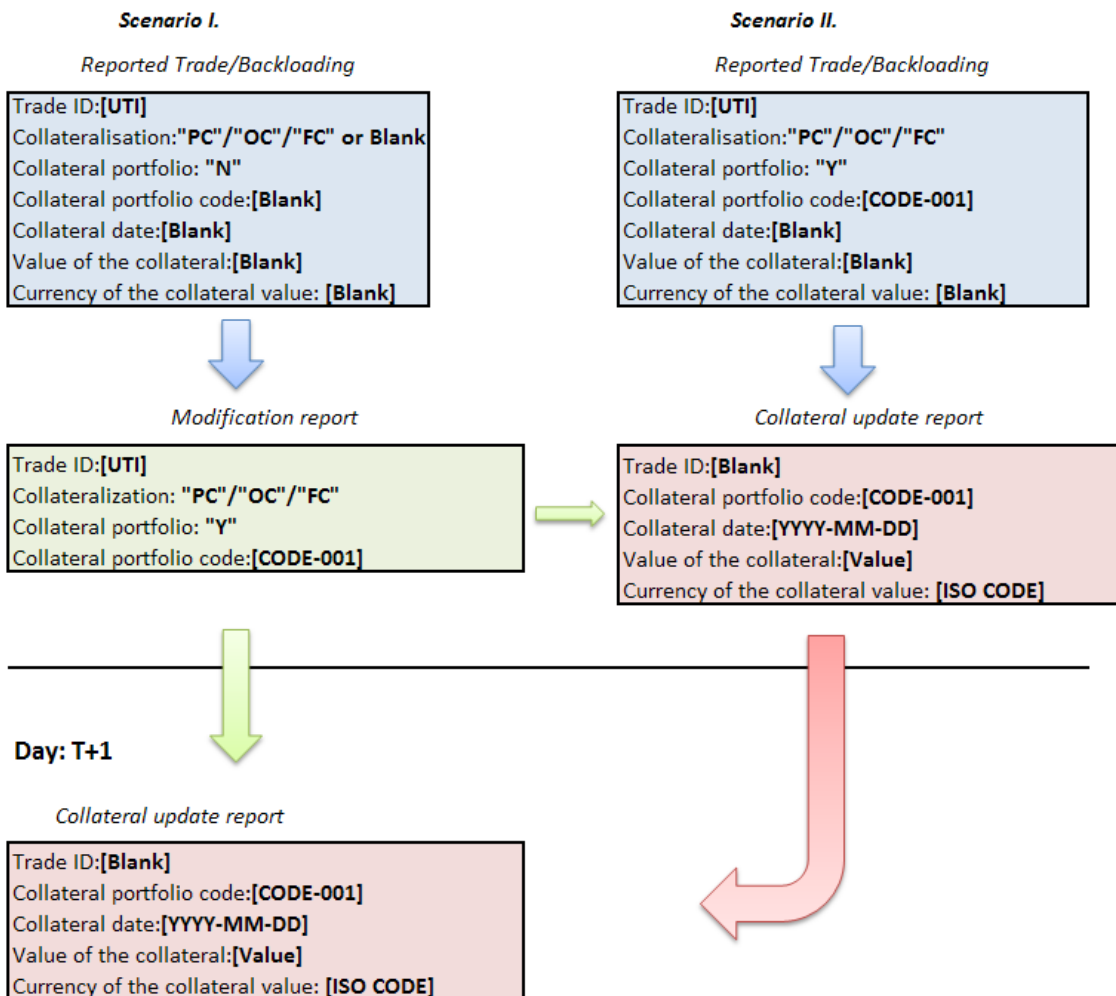
Az első esetben (Scenario I.) a biztosítéki információkat **NEM** tartalmazza az eredeti Backloading (BL) vagy Reported Trade (RT) üzenet. Ez jellemzi az eddig beküldött jelentéseket, hiszen elmondható, hogy az elmúlt időszakban jelentett ügyletek kapcsán nem kerültek a biztosítékokra vonatkozó értékek jelentésre, a legtöbb jelentésben maximum az került feltüntetésre, hogy az ügylet mögött van biztosíték, azonban ennek értéke már nem.

Az ezekkel az ügyletekkel kapcsolatos biztosítéki információkat először egy CU üzenetben kell lejelenteni, majd ezek után a további biztosítéki módosításokat, frissítéseket szintén egy CU üzenettípusban kell megadni, a fentiek szerint megadott kitöltéssel.

A második forgatókönyv (Scenario II.) azt az esetet mutatja be, amikor az eredeti RT vagy BL üzenet már tartalmazta a biztosítéki információt. Ezek után a további biztosítéki adatfrissítéseket a CU üzenettípusban kell megadni, ez összefoglalja és frissíti a biztosíték dátumát és értékét, hivatkozik az ügylet UTI-ra, amelyre vonatkozóan a biztosítéki információt frissíteni kell.

## II. Biztosítékok több ügylethez kapcsolódóan, portfólió alapon kerültek lejelentésre

Day:T



Az első eset (Scenario I.) az mutatja be, amikor az ügyletek mögötti biztosítéki portfólió nem került egyből lejelentésre, hanem az csak később, egy „Modification” üzenettel kerül megadásra. Ebben az esetben csak a „Modification” üzenet követően kerülhet sor a CU üzenetek jelentésre.

A második forgatókönyv (Scenario II.) azt az esetet szemlélteti, amikor a portfólió kódot már az eredeti jelentés is tartalmazza. Ebben az esetben a biztosítékban történt változásokat egyből lehet CU üzenetekkel frissíteni.

#### **A Collateral Update üzenettel kapcsolatos főbb tudnivalók:**

- Amennyiben egy ügyletet egy portfólióhoz rendeltek, a CU üzenetekben csak a **Portfolio Code**-ot kell megadni (és nem az UTI-kat). Az adott biztosítéki portfólióhoz rendelt valamennyi ügylet és pozíció egyidejűleg frissül, nem kell egyedi üzenetet küldeni minden ügyletre/pozícióra.
- Már jelentett ügylet esetében a biztosítéki adatok változtatására csak akkor használható „Modification” üzenet, ha az eredeti üzenet nem tartalmazta a vonatkozó biztosítéki információkat és a jelentő fél az ügyletet egy adott biztosítéki portfólióhoz kapcsolja.
- Ha a collateral update (CU) tévesen került kiküldésre, másik CU üzenetet kell küldeni, amely „felülírja” az előzőt és annak helyébe lép. Módosítási üzenetek nem használhatóak a biztosítéki érték módosítására.
- Az „Action type” (ESMA CD58 mező) CU üzenet esetében „V” (=validation update). A „V” action típus alapbeállítás a CU üzeneteknél és a jelentést küldőknek nem kell külön beállítania.
- A formai ellenőrzésen túl a KELER rendszerében a CU üzenetek kontextus ellenőrzésen is átmennek és a következő okok bármelyike esetén elutasításra kerülnek:
  - Ha a **Collateralization** mező értéke „U” (uncollateralized, biztosíték nélküli), **nem lehet értéket jelenteni a Collateral Portfolio és a Collateral Portfolio Code mezőkben;**
  - Ha a **Collateral Portfolio** mező értéke „Y” (yes), az értéket a **Collateral Portfolio Code** mezőben is jelenteni kell;
  - Ha a **Collateral Portfolio** mező értéke „N” (no), **nem szabad értéket jelenteni a Collateral Portfolio Code** mezőben;
  - **Nem lehetséges ugyanabban az üzenetben jelenteni mind a Trade ID (UTI), mind a Collateral Portfolio Code** mezők értékét;
  - **A CU üzeneteket időrendi sorban kell jelenteni.**

### Valuation riportok

Az EMIR kimondja, hogy a pénzügyi (FC) és a klíring küszöbérték feletti nem-pénzügyi (NFC+) szerződő feleknek az ügyletek értékelést naponta és mindkét fél részéről meg kell küldeni. Az értékelés aktualizálás jelentésének célja, hogy a szabályozók információval rendelkezzenek a kitétségek napi változásáról.

Az EMIR előírása szerint az értékelési adatok jelentését az ügylet megkötését követő nap végén kell megkezdni. Az értékelések megküldhetőek napközben is vagy a nap végén. Az értékelésekre vonatkozóan a kereskedési adattár nem végez számításokat.

Ha egy ügyletre egy adott napon több értékelést is beadtak, az adattár a következő szabályok alkalmazásával határozza meg, hogy melyik értékelést jelenti a szabályozónak:

#### Ha a nap során adtak be értékelési jelentéseket:

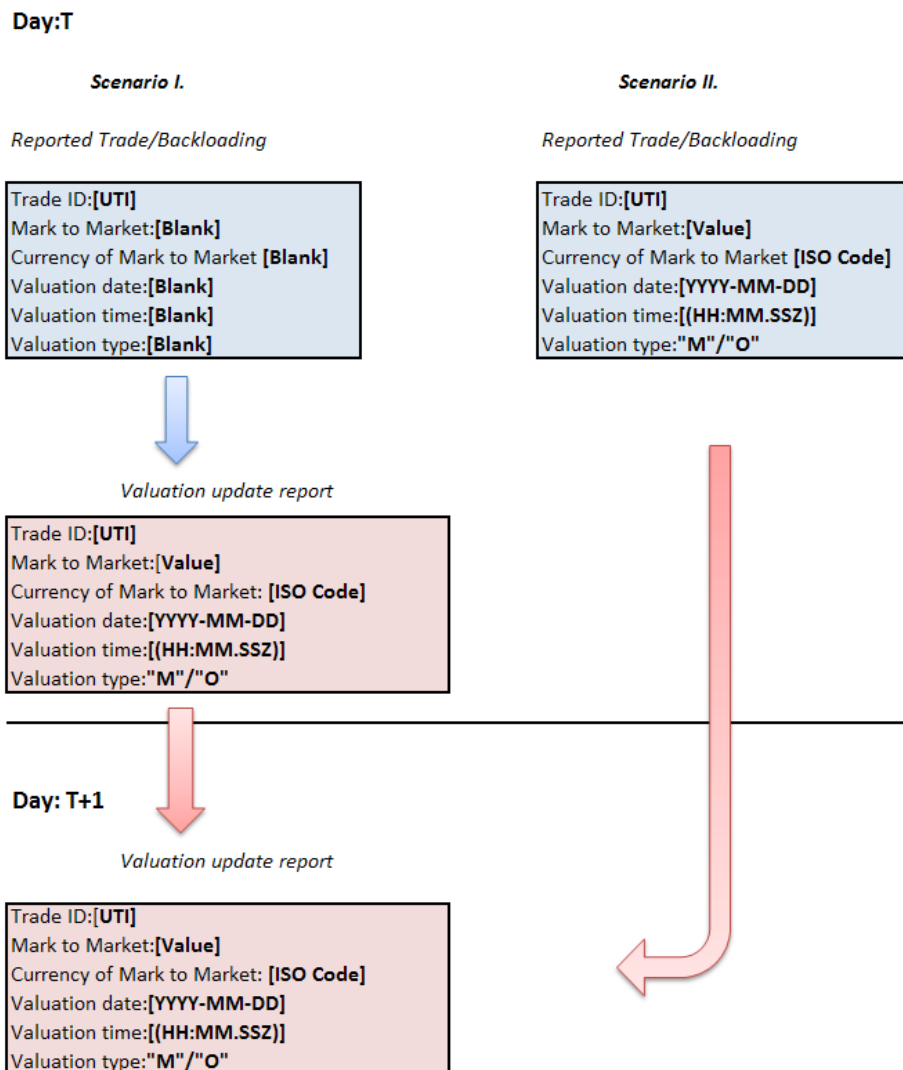
- Ha az ügyletben résztvevő valamelyik fél saját nevében beadta saját értékelését, az adattár a legutóbb beadott értékelést használja (értékelés napja és időpontja alapján, ha egynél több jelentést adtak be a nap során). Az üzenettípus nem jelent prioritást, azt a jelentést kell kiválasztani, amelynek az értékelési napja és időpontja a legutóbbi.
- Ha az ügyletben résztvevő fél nem adott be saját nevében értékeléseket, az adott fél nevében más résztvevő által beadott legutóbbi jelentést kell használni.

Ha a nap során nem adtak be értékelési jelentéseket az adott ügyletre, a legutóbbi napon beadott értékelési jelentéseket kell figyelembe venni.

Az értékelések aktualizálása a biztosítékok aktualizálásánál bemutatotthoz képest eltérő logikát követ. Az értékelés aktualizálásának beküldésekor figyelembe kell venni a következőket:

- az eredetileg jelentett ügylet tartalmazhatja az értékelési információt (RT/BL);
- az értékelési adatok rész üresen is hagyható az eredetileg jelentett ügyletben (RT/BL) és az értékelési adatok külön valuation update (VU) üzenetben is megküldhetők.

Így attól függően, hogy az eredetileg jelentett ügyletben van -e hivatkozás, az alábbi két eset egyike következhet be.



Az első eset (Scenario I.) azt írja le, amikor az eredeti ügylet nem tartalmazta az értékelési információkat. Ez akkor fordulhat elő, ha az ügyletet az értékelési jelentési kötelezettség életbe lépése előtt már jelentették (azaz az ügylet 2014. augusztus 11-e előtt került lejelentésre).

Ha az értékelési adatokat az eredeti ügylet részeként nem jelentették, az első értékelési információt külön „valuation update” (VU) üzenetben kell jelenteni, hivatkozva az ügylet azonosítójára (UTI). Majd a további értékelési aktualizálás VU üzenettípusban adható be.

A második eset (Scenario II.) azt mutatja be, amikor már az eredeti jelentés tartalmazza az értékelésre vonatkozó adatokat.

#### **A Valuation Update üzenettel kapcsolatos főbb tudnivalók:**

- Az ügylet vagy a pozíció értékelési információinak megadása után a kitétséggel kapcsolatos bármilyen adat módosításához nem használható a „Modification message”;

Hibás jelentés esetén a „Trade Cancellation” üzenettel törölhető az ügylet. Az új szabályok szerint ebben az esetben a korábban jelentett Trade ID ismét felhasználható lesz, így ezzel a korábban hibásan jelentett ügylet ismét lejelenthető lesz;

#### **ESMA Q&A**

Az ESMA honlapján elérhető a legfrissebb Q&A melyben főleg a biztosítékokkal és értékelésekkel kapcsolatos új kérdések kerültek megválaszolásra.

#### A biztosítékok jelentésével kapcsolatos fontosabb információk:

- A biztosítékok értékénél azt az értéket kell feltüntetni, ami az biztosítékot nyújtó fél részéről megképzésre kerül, ezt az értéket nem kell módosítani az esetleges haircut-okkal vagy egyéb hasonló tételekkel;
- Mivel a biztosíték eszközök értékének meghatározására csak egyetlen egy mező áll rendelkezésre, ezért a portfólió alapon képzett biztosítékok esetében is egyetlen értéket kell megadni a megképzett biztosítékokra vonatkozóan. A portfólió alapon nyújtott biztosítékok értékét az adott portfólióban legnagyobb súlyt képviselő elem devizanemében kell kifejezni;
- A nem pénzbeli biztosítékokat is pénzben kell meghatározni;
- A biztosítékokat csak a biztosítékot nyújtó félnek kell jelentenie;
- A biztosítékokat és értékeléseket először 2014 augusztus 11-re vonatkozóan kell jelenteni, legkésőbb 2014. augusztus 12-ig

#### A biztosítékeszközökkel való fedezettség (collateralisation) mező lehetséges értékei:

“Uncollateralised” – A származékos ügylet akkor “Uncollateralised”, ha a bejelentő szerződő fél az érintett származékos szerződésre egyáltalán nem nyújt biztosítékot (sem alapletétet sem változó letétet.)

“Partially Collateralised” – A származékos ügylet akkor “Partially Collateralised”, ha a szerződő felek megállapodása szerint vagy az egyik vagy mindkét szerződő fél rendszeresen nyújt változó letétet és vagy egyáltalán nem cserélnék alapletétet vagy csak a bejelentő szerződő fél kap alapletétet.

“One-way Collateralised” – A származékos ügylet akkor “One-way Collateralised”, ha a szerződő felek megállapodása szerint a származékos ügylet vonatkozásában csak az azt bejelentő szerződő fél nyújt alapletétet, míg változó letétet rendszeresen mindkét fél nyújthat.

“Fully Collateralised” – A származékos ügylet akkor “Fully Collateralised”, ha a szerződő felek megállapodása szerint alapletétet és rendszeresen változó letétet kell nyújtania mindkét szerződő félnek.

A „rendszeres” szó használata a fentiekben kizárja azokat az eseteket, amikor a szerződő felek megállapítanak egy/több küszöbértéket, amely/amelyek annyira magas/magasak, hogy az egyik vagy mindkét szerződő fél ritkán vagy sosem nyújt változó letétet.

A fentiek alapján az alábbiak szerint töltendő a „collateralisation” mező

	A "collateralisation field" kitöltése	
	Counterparty 1	Counterparty 2
Változó letétet csak a CP1 ad, nincs alapbiztosíték	PC	U
Változó letétet mindkét fél ad, nincs alapbiztosíték	PC	PC
Változó letét és alapbiztosíték is van CP1 esetében, de CP2-nél egyik sincs	OC	U
CP1 nyújt alapbiztosítékot és mindkét fél nyújt változó letétet	OC	PC
Mindkét partner nyújt változó és alapbiztosítékot is	FC	FC
Egyik fél sem nyújt biztosítékot	U	U

## REGIS-TR ÁLTAL VÉGZETT FRISSÍTÉSEK, MÓDOSÍTÁSOK

Az alábbiakban kerültek összefoglalásra a REGIS-TR részéről július közepével (várhatóan 2014. július 14-vel) élesedő új verzióban található változások. Az új fejlesztések olyan régóta várt funkciókat tesz lehetővé, mint például:

- A jelentésben szereplő felek azonosítójának módosítása (Modification of Counterparty IDs);
- A jelentések ellenőrzése során az ID type mező figyelmen kívül hagyása;
- Törlési protokoll módosulása;
- Delegált jelentések esetén a „sell” és „buy” indikátor módosítása.

A fejlesztések a KELER rendszerében is lekövetésre kerültek.

### A jelentésben résztvevő felek azonosítójának (Party és Counterparty ID) módosítása

A Legal Entity Identifier (LEI) kód használata kiemelten fontos a jelentések során. Egyrészt ezzel történik az ügyletben résztvevő felek azonosítása, másrészt lehetővé teszi a lejelentett ügylet két oldalának egyeztetését, rekonziliálását.

A jelentési kötelezettség kezdetekor a piaci szereplők jelentős része még nem rendelkezett ezzel azonosítóval, LEI hiányában pedig ezen ügyfelek BIC vagy egyéb kóddal, mint pl. ügyfélazonosítóval kerültek feltüntetésre a kereskedési adattár felé küldött jelentésben.

Az elmúlt hónapok során egyre több ügyfél szerezte meg LEI kódját, azonban nem történt meg ezen partnerek szinkronizálása, a korábban jelentett ügyletekben az újonnan megszerezett LEI kódok nem kerültek átvezetésre.

Ezek pedig a jelentések során az alábbi problémákat eredményezik:

- A már lejelentett ügyletekre beküldött módosítások (pl.: Modification report) elutasításra kerültek, mert a jelentésben használt azonosító (Party ID) nem egyezett meg az eredeti üzenetben használt azonosítóval;
- Amennyiben az ügyletben résztvevő felek mindegyike külön jelenti a saját oldalát és az egyik fél magát az újonnan megszerzett LEI kódjával, még öt a másik fél a korábban használt BIC kódjával tünteti fel a jelentésen, akkor a később jelentett ügylet elutasításra kerül, mivel a közös ügyletazonosítóhoz (Trade ID) különböző partnerek tartoznak. (Egyik jelentésben az adott partner BIC kóddal még a másikban LEI-vel került lejelentésre).
-

A fent jelzett problémák kezelése érdekében a REGIS-TR egy új jelentéstípust vezetett be „Id Modification - IM” mellyel lehetőség lesz a korábban lejelentett party és counterparty ID adatok módosítására.

Fontos tudnivalók az új IM riport kapcsán:

- Ez az új riport csak aktív ügyletek esetében alkalmazható, azaz már lejárt ügyletek esetében nincs lehetőség a Party és Counterparty adatok utólagos módosítására;
- Delegation „Y”-el jelentett ügyletek esetében az ügyletben szereplő mindkét fél jelentésében átvezetésre kerül a módosított ID, míg a Delegation „N” esetében csak a módosítást bejelentő fél oldalán kerül a módosított ID átvezetésre;
- Az üzenetben csak a LEI módosítása jelenthető. Egyéb módosítások vagy például LEI javításokra nincs lehetőség. Azaz egy korábban rossz LEI-vel jelentett ügylet esetében a LEI javítására csak a korábbi ügylet törlésével (Trade Cancellation) és újbóli beküldésével (már a helyes LEI-vel) van lehetőség.
- Ezzel az új üzenettel megoldható, hogy az időközben LEI azonosított szerzett ügyfelek korábban pl. BIC azonosítóval jelentett ügyleti is módosításra kerüljenek, hiszen az IM riport küldését követően, a korábbi ügyletben is átvezetésre kerül az új azonosító.
- Az ID Modification üzenet kapcsán nincs új struktúra, ilyen üzenetek esetében a jelenleg meglévő Modification üzenet használandó, amiben csak a party és counterparty adatok megadására van szükség. Party részhez a korábban jelentett azonosító (pl.: BIC) még a counterparty részhez az új azonosítót (LEI kód) kell megadni.

**ID típus figyelmen kívül hagyása a „másik partnerre” (counterparty type) vonatkozó mezőben**

A REGIS-TR módosította a Party és Counterparty adatok ellenőrzésre vonatkozó protokollt. A módosítás alapján a jövőben, amennyiben egy ügylet a két fél részéről külön kerül lejelentésre, akkor a másodikként jelentő ügyfél esetében nem vizsgálja az „Identification type” mező értékét, csak az vizsgálja, hogy a feltüntetett azonosító megfelel-e az elvárásnak, azaz például a LEI kód valóban 20 karakterből áll-e vagy sem.

### Törlési „protokoll” módosulása

Annak érdekében, hogy a piaci szereplők az EMIR-ben előírt jelentési határidőt betartsák, az indulásnál számos ügylet helytelenül vagy nem feltétlenül a megfelelő adatokkal került lejelentésre. Sajnálatos módon mindeddig nem volt lehetőség a már lejárt vagy törölt ügyletek módosítására. A REGIS-TR azonban az új verzió keretében biztosítja az ügyfelei számára, hogy a már időközben lejárt vagy törölt (Trade Cancellation) Backloading vagy Reported Trade ügyletek esetében van lehetőség az ügyletek utólagos módosítására.

Az ügyletek módosítás ebben az esetben nem a „Modification” üzenettel történik, hanem az utólag módosítandó ügyletekre egy Trade Cancellation üzenetet kell beadni, melyet követően van lehetőség a korábban használt egyedi ügyletazonosító (UTI vagy ITI) ismételt felhasználásával újból, immár a helyes értékekkel lejelenteni az ügyletet.

Például: Egy 2014. február 20-án lejárt Backloading ügyletre vonatkozóan van lehetőség Trade Cancellation üzenet beadására. Ennek hatására pedig a korábban Backloadingként jelentett ügyletben használt Trade ID ismét felhasználható és egy új Backloading jelentéssel az ügylet ismét feladható.

### Pozíciók esetében a vevői és eladói oldal módosítása

A napi ügyletkötéseket követően van lehetőség az ügyletek pozícióba történő összevonására és így a kapott pozíció lejelentésére, ugyanakkor a delegált jelentéseknél mindeddig nem volt megengedett, a vevői vagy eladói pozícióban bekövetkezett pozitív vagy negatív változások lejelentésére. (Buy sell indikátor változása).

A REGIS -TR mostani fejlesztése lehetővé teszi, hogy delegált jelentések esetében is, az egyik fél lejelentése alapján mindkét félnél szükség szerint módosul a fent említett indikátor.

Például: Amennyiben indulásnál az egyik fél a vevői, a másik az eladó pozícióban volt és ez az újabb ügyletkötések hatására változik, akkor elég az egyik félnek ezt a változást lejelentenie és ez mindkét ügyfél esetében helyesen fog változni.

### Kereskedési hely (Venue) mező ellenőrzése

A REGIS-TR új verziójában ez a mező ellenőrzése is nagyobb figyelmet kap. Innentől kezdve csak az ESMA technikai standardokban leírtak szerint, a jelentések során csak a 4 karakterből álló tőzsdekód kerül elfogadásra. Amennyiben ez az információ az ügyletkötésnél nem áll rendelkezésre, akkor ez a mező üresen is hagyható.

A technikai standardokon kívül az ESMA Q&A munkaanyaga is foglalkozik a jelentések kapcsán használható tőzsdekódokkal.

Az alábbi linken találhatóak a tőzsdék és MTF-ek esetében használandó kódok:[http://mifiddatabase.esma.europa.eu/Index.aspx?sectionlinks\\_id=23&language=0&pageName=REGULATED\\_MARKETS\\_Display](http://mifiddatabase.esma.europa.eu/Index.aspx?sectionlinks_id=23&language=0&pageName=REGULATED_MARKETS_Display)

### Jelentett ügyletek adatainak rekonziliációja

Az egyes ügyletek jelentése előtt a felek felelősége, hogy egyeztessék a jelentésben szereplő adatokat. A nap végével a kereskedési adattárak is összevetik a feléjük küldött jelentéseket.

**A kereskedési adattárak által végzett rekonziliálás alapját az egyedi ügyletazonosító (UTI) adja.**

Amennyiben egy ügylet mindkét oldala egy jelentésben került beküldésre, akkor ez a jelentés nem kerül rekonziliálásra.

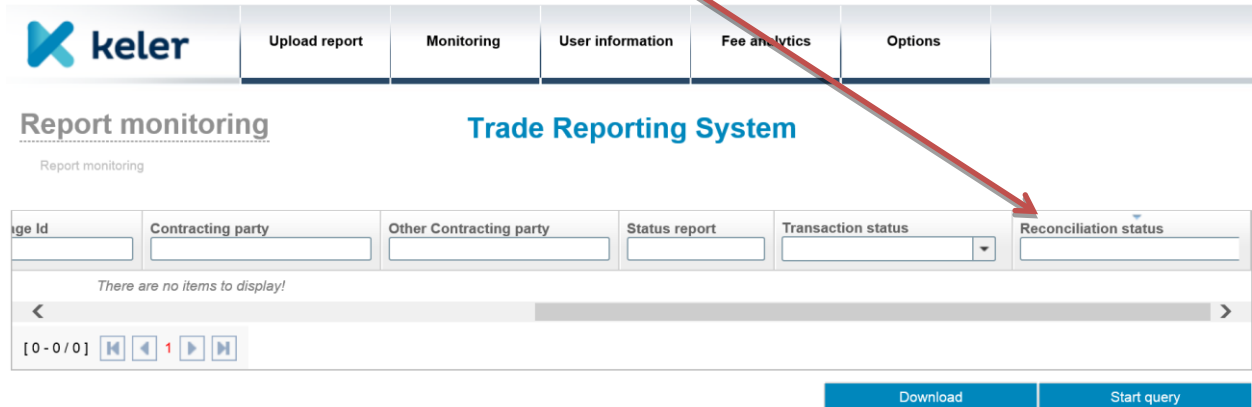
Eddig csak arra volt lehetőség, hogy nap végén az adott kereskedési adattár a saját nyilvántartásával tudta összevetni a felé jelentett ügyleteket, azonban a jövőben a kereskedési adattárak a nap végén egymással is összevetik a feléjük jelentett ügyleteket.

Ez azt jelenti, hogy mind a 6 európai adattár egymás között rekonziliálja a felé jelentett ügyleteket, így egyre gyakrabban előfordulhat olyan eset, hogy ugyan nap közben egy ügylet befogadásra került (Trade Status), de a nap végi rekonziliálás miatt mégis módosítani kell azt a következő napon.

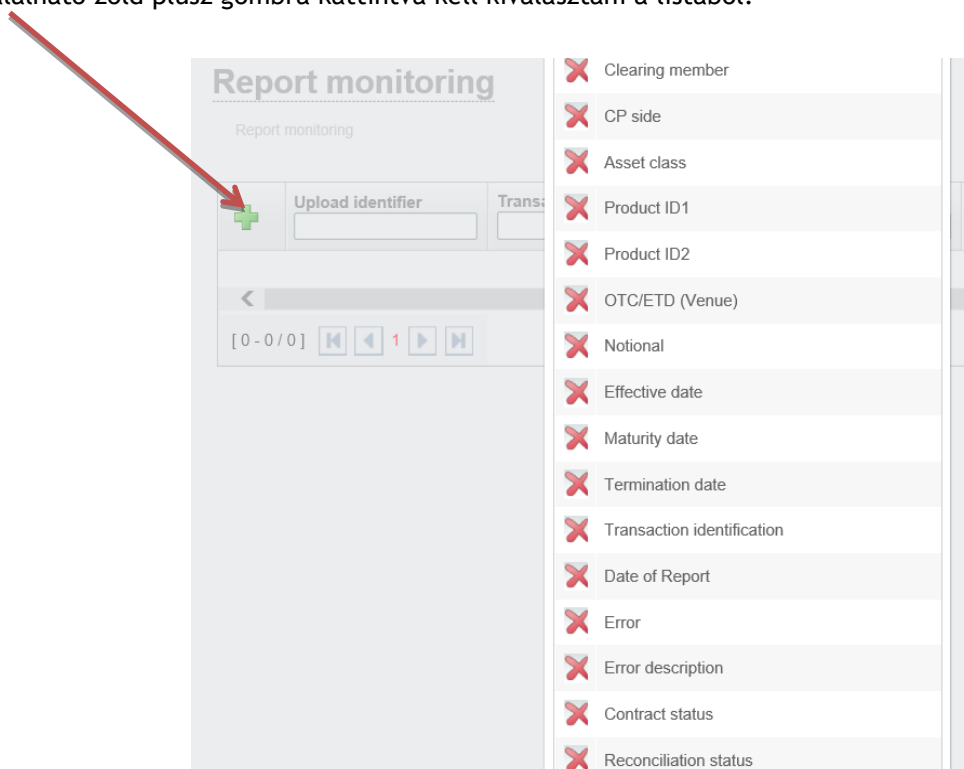
A REGIS-TR esetében a rekonziliálást követően hibásnak jelzett ügyletek státusza nem változik (azok továbbra is Trade Statusban maradnak), azonban egyeztetni kell a partnerrel, hogy melyik mezők esetében mi okozta az eltérést és a javítások érdekében egy „Modification” üzenetben kell módosítani a korábban jelzett adatokat.

A KELER Trade Reporting rendszerében a Jelentés monitoring (Report monitoring) felületen lehet megtekinteni a rekonziliálás eredményét. Jelenleg a két fél által külön jelentett ügyletek esetében felmerülő eltérések láthatók, és az, hogy emiatt a rekonziliálás FAIL státuszba került. Jelenleg fejlesztés alatt van az új verzió, melyben már nemcsak a rekonziliálás eredménye lesz látható, hanem megadásra kerül, hogy mely értékek nem stimmeltek a két jelentésben, ezzel megkönnyítve az eltérések kijavítását.

A rekonziliálás státusza a Report (jelentés) monitoring funkcióban található:



A „Reconciliation status” mező alapesetben nem szerepel az oszlopok között, azt az oszlopok előtt található zöld plusz gombra kattintva kell kiválasztani a listából.



A lejelentett ügyletek kereskedési adattárak egymás közötti rekonziliálása során az alábbi tolerancia szintek kerültek bevezetésre:

- **Tolerance 1** - e mezők esetében az eltérés nem haladhatja meg az 1%-ot;
- **Tolerance 2** - e mezők esetében szereplő értékeknek a tizedes pontig meg kell egyezniük;
- **Tolerance 3** - e mezőben szereplő értékeknek, időpontoknak a dátumig meg kell egyezniük.

Az alábbiakban összefoglalásra került, hogy az egyes mezők esetére melyik Tolerancia érték vonatkozik.

No.	Name	ESMA Format	Match/ Tolerance Rule to other trade
2	Counterparty Id	LEI	Must match id of the other counterparty
3	ID of the other counterparty	LEI	Must match id of the counterparty
13	Counterparty side	B = buyer, S = seller	Must be S if B and B if S

Field Ref.	Name	ESMA Format	To be reconciled (Y or N)
CD1	Taxonomy used	Identify the taxonomy used: U=Product Identifier [endorsed in Europe] I=ISIN/All + CFI E=Interim taxonomy	Y
CD2	Product id 1	For taxonomy = U: Product Identifier (UPI), to be defined For taxonomy = I: ISIN or All, 12 digits	Y

		alphanumeric code For taxonomy = E: Derivative class: CO=Commodity CR=Credit CU=Currency EQ=Equity IR=Interest Rate OT= Other	
CD3	Product id 2	For taxonomy = U: Blank For taxonomy = I: CFI, 6 characters alphabetical code For taxonomy = E: Derivative type: CD= Contracts for difference FR= Forward rate agreements FU= Futures FW=Forwards OP=Option SW=Swap OT= Other	Y
CD4	Underlying	ISIN (12 alphanumeric digits); LEI (20 alphanumeric digits); Interim entity identifier (20 alphanumeric digits); UPI (to be defined); B= Basket; I=Index.	Y
CD5	Notional currency 1	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits.	Y
CD6	Notional currency 2	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits.	Y
CD7	Deliverable currency	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits.	N
CD8	Trade id	Up to 52 alphanumeric digits.	Y
CD9	Transaction reference number	An alphanumeric field up to 40 characters	N
CD9	Transaction reference number	An alphanumeric field up to 40 characters	N
CD10	Venue of execution	ISO 10383 Market Identifier Code (MIC), 4 digits alphabetical.  Where relevant, XOFF for listed derivatives that are traded off-exchange or XXXX for OTC derivatives.	Y

CD11	Compression	Y = if the contract results from compression; N= if the contract does not result from compression.	Y
CD12	Price/rate	Up to 20 numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y-Apply tolerance check 1
CD13	Price notation	E.g. ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits, percentage.	Y
CD14	Notional amount	Up to 20 numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y- Apply tolerance check 2
CD15	Price multiplier	Up to 10 numerical digits.	Y
CD16	Quantity	Up to 10 numerical digits.	Y
CD17	Up-front payment	Up to 10 numerical digits in the format xxxx,yyyyy for payments made by the reporting counterparty and in the format xxxx,yyyyy for payments received by the reporting counterparty.	Y- Apply tolerance check 1
CD18	Delivery type	C=Cash, P=Physical, O=Optional for counterparty.	Y
CD19	Execution timestamp	ISO 8601 date format / UTC time format.	Y- Apply tolerance check 3 for OTC. For ETD, a tolerance of +/- one hour

CD20	Effective date	ISO 8601 date format.	Y
CD21	Maturity date	ISO 8601 date format.	Y
CD22	Termination date	ISO 8601 date format.	Y
CD23	Date of settlement	ISO 8601 date format. Note that RTS defines this as date of settlement of the <u>underlying</u>	N
CD24	Master agreement type	Free Text, field of up to 50 characters, identifying the name of the Master Agreement used, if any.	N
CD25	Master agreement version	Year, xxxx.	N
CD26	Confirmation timestamp	ISO 8601 date format, UTC time format.	Y- Apply tolerance check 3
CD27	Confirmation means	Y=Non-electronically confirmed, N=Non-confirmed, E=Electronically confirmed.	Y
CD28	Clearing obligation	Y=Yes, N=No.	Y
CD29	Cleared	Y=Yes, N=No.	Y
CD30	Clearing timestamp	ISO 8601 date format, UTC time format.	Y- Apply tolerance check 3

CD31	CCP	Legal Entity Identifier (LEI) (20 alphanumeric digits) or, if not available, interim entity identifier (20 alphanumeric digits) or, if not available, BIC (11 alphanumeric digits).	Y
CD32	Intragroup	Y=Yes, N=No.	Y
CD33	Fixed rate leg 1 (tolerance tba)	Numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y- Apply tolerance check 1
CD34	Fixed rate leg 2 (tolerance tba)	Numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y - Apply tolerance check 1
CD35	Fixed rate day count	Actual/365, 30B/360 or Other.	N
CD36	Fixed leg payment frequency	An integer multiplier of a time period describing how often the counterparties exchange payments, e.g. 10D, 3M, 5Y.	N
CD37	Floating leg payment frequency	An integer multiplier of a time period describing how often the counterparties exchange payments, e.g. 10D, 3M, 5Y.	N
CD38	Floating leg reset frequency	An integer multiplier of a time period describing how often the counterparties exchange payments, e.g. 10D, 3M, 5Y.	N
CD39	Floating rate of leg 1	The name of the floating rate index, e.g. 3M Euribor.	N

CD40	Floating rate of leg 2	The name of the floating rate index, e.g. 3M Euribor.	N
CD41	Currency 2	ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits.	Y
CD42	Exchange rate 1	Up to 10 numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y- Apply tolerance check 1
CD43	Forward exchange rate	Up to 10 numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y- Apply tolerance check 1
CD44	Exchange rate basis	E.g. EUR/USD or USD/EUR. 2 X ISO 4217 Currency Code, 3 alphabetical digits separated by a slash.	Y
CD45	Commodity Base	<ul style="list-style-type: none"> <li>- <b>AG: Agricultural</b></li> <li>- <b>EN: Energy</b></li> <li>- <b>FR: Freights</b></li> <li>- <b>ME: Metals</b></li> <li>- <b>IN: Index</b></li> <li>- <b>EV: Environmental</b></li> <li>- <b>EX: Exotic</b></li> </ul>	Y
CD46	Commodity Details	Agricultural <ul style="list-style-type: none"> <li>- <b>GO:</b>Grains oilseeds</li> <li>- <b>DA:</b> Dairy</li> <li>- <b>LI:</b> Livestock</li> <li>- <b>FO:</b> Forestry</li> <li>- <b>SO:</b> Softs</li> </ul> Energy <ul style="list-style-type: none"> <li>- <b>OI:</b> Oil</li> <li>- <b>NG:</b> Natural gas</li> <li>- <b>CO:</b> Coal</li> <li>- <b>EL:</b> Electricity</li> <li>- <b>IE:</b> Inter-energy</li> </ul>	Y

		Metals - <b>PR:</b> Precious - <b>NP:</b> Non-precious  Environmental - <b>WE:</b> Weather - <b>EM:</b> Emissions	
CD47	Delivery Point or zone (energy)	EIC code, 16 character alphanumeric code.	Y
CD48	Interconnection point (energy)	Free text, field of up to 50 characters.	N
CD49	Load Type (energy)	Repeatable section of fields 50-54 to identify the product delivery profile; BL=Base Load PL=Peak Load OP=Off-Peak BH= Block Hours OT=Other	Y
CD50	Delivery start date time (energy)	ISO 8601 date format.	Y
CD51	Delivery end date time (energy)	ISO 8601 date format.	Y
CD52	Contract Capacity (energy)	Free text, field of up to 50 characters.	N

CD53	Quantity Unit (energy)	10 numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y -Apply tolerance check 1
CD54	Price/time interval quantities (energy)	10 numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y- Apply tolerance check 1
CD55	Option type	P=Put, C=Call.	Y
CD56	Option style	A=American, B=Bermudan, E=European, S=Asian.	Y
CD57	Strike price	Up to 10 Numerical digits in the format xxxx,yyyyy.	Y - Apply tolerance check 2
CD58	Action type	One character indicator (N, M, O, E, C, Z)	N
CD59	Details of action type	Free text field	N

### KSZF ÁLTAL GENERÁLT RIPORTOKAT ÉRINTŐ VÁLTOZÁSOK

A KELER KSZF a szolgáltatást igénylő ügyfelei számára napi szinten elkészíti és a KID-en keresztül elérhetővé teszi a klíringtag és megbízója közötti ügyletek lejelentéséhez szükséges riportokat melyek letöltés után módosítás nélkül feltölthetőek a KELER Trade Reporting rendszerében.

Jelenleg csak az ügylet lejelentéséhez szükséges riportok kerülnek előállításra, míg például a biztosítékokra illetve a napi értékelésre vonatkozó kimutatások nem.

Az EMIR és az ESMA Q&A munkaanyagának való megfelelés érdekében 2014. augusztus 11-től a KSZF változtat a jelenlegi gyakorlatán.

### Pozíciók jelentése a klíringtag és megbízója közötti ügyletek kapcsán

Az eddigi gyakorlattól eltérően a 2014. augusztus 11-től a KSZF a klíringtag és megbízója közötti ügyletek esetében előállítja a pozíciós jelentéseket is.

A gyakorlatban ez annyit jelenet, hogy

- az eddigieknek megfelelően, napi szinten elkészíti az ügyletek lejelentéséhez szükséges riportokat,
- minden lejelentett ügyletre vonatkozóan előállít egy Trade Compression üzenetet, mely alapján
- a korábban jelezett ügyletek törlésre kerülnek, jelezve azt, hogy az ügylet nettósításra került,
- a Compression üzenetet követően meggenerálja a pozíciók lejelentéséhez szükséges riportokat.

Az ügyletkötést követő napon kötött ügyletek esetében is előállnak a Reported Trade és Compression üzenetek, míg a korábban lejelentett pozíciókat érintő változások egy Modification üzenettel kerülnek lejelentésre.

Amennyiben egy adott nap során a megbízó egy adott termékből adott lejáratra ugyanolyan mennyiségben vesz és el is ad, akkor ez a két ügylet külön kerül lejelentésre, majd minkét ügyletre előáll a Trade Compression üzenet. A pozícióra azonban nem készül Modification üzenet, hiszen maga a pozíció értéke nem változik.

A fenti megoldás díjfizetés szempontjából kedvezőbb a klíringtagok számára, hiszen a REGIS-TR díjait figyelembe véve csak a pozíciók után kell megfizetni a havi 10 Ft nyilvántartási díjat, nem pedig ügyletenként. Adott hónapban ugyanazzal a termékkel többet kereskedő megbízó esetében pedig ez jelentős csökkentést eredményezhet.

Mivel a pozíció egy új, az ügyletektől eltérő UTI-al kerül lejelentésre ezért a pozíciók jelentése kapcsán 6 Ft jelentési díj kerül felszámításra, ez azonban még mindig kevesebb, mintha minden egyes ügyletre vonatkozóan külön 10 Ft nyilvántartási díjat kellene fizetni. A megtakarítás még inkább szembetűnő a hosszabb lejáratú ügyleteknél, hiszen azok esetében jelenleg a lejáratig minden hónapban ügyletenként kerül a nyilvántartási díj felszámításra, míg az új megoldásnak köszönhetően a pozíció lejelentését követően már csak egyszer kell ezt a díjat megfizetni.

A pozíciókra küldött Modification üzenetek után továbbra sincs díjfizetési kötelezettség.

### Valuation és Collateral update riportok

Az EMIR előírása alapján csak a pénzügyi (FC) és a klíring küszöbérték feletti nem-pénzügyi (NFC+) szerződő feleknek kell a biztosítékokat és az ügyletek értékelését jelenteni. Ennek megfelelően a klíring küszöbérték alatti nem-pénzügyi szerződő feleknek (NFC-) nem is kell feltüntetniük a jelentésekben ezeket az értékeket.

A fentiek alapján a KSZF által generált jelentésekben ezen értékek az NFC- megbízók esetében nem is kerülnek feltüntetésre, valamint ezen ügyletekre nem is kell valuation és collateral update üzeneteket küldeni.

A KID-ben minden jogi személy megbízó vonatkozásban, fel lehet tüntetni annak pénzügyi jellegét. A KSZF az FC-ként jelölt megbízók vonatkozásában külön állítja elő a jelentéseket, azaz az eddigiektől eltérően amennyiben egy klíringtagnak van legalább egy FC megbízója, akkor arra vonatkozóan a nem-pénzügyi szereplőktől történő megkülönböztetés miatt külön fájl kerül előállításra.

Az új eljárás azért kerül bevezetésre, mert az FC megbízók tekintetében szükséges az ügyletek mögött biztosítéki adatok megadása, amire vonatkozóan viszont a KSZF nincs információja.

A külön fájl segíti a klíringtagot abban, hogy az FC estében könnyebben megadja a szükséges információkat, hiszen így nem kell keresni, hogy melyik megbízó esetében van szükség a biztosítékérték megadására. A KSZF által FC megbízók nevében előállított jelentésekben a biztosíték értéken kívül minden adat megadásra kerül.

A Valuation riportot az NFC-s megbízókhoz hasonlóan az FC megbízók számára is előállítja a KSZF, ami kiegészítés nélkül feltölthető a KELER felé.

### Jelentések automatikus feltöltése

Igényként merült fel, hogy a KSZF által előállított riportok automatikusan kerülhessenek feladásra a KELER és így a REGIS-TR felé, azaz ne keljen napi szinten a fájlokat letölteni a KID rendszerből.

A KSZF vizsgálja az automatikus feltöltés jogi és IT oldalát, azonban biztosnak tűnik, hogy a 2014. augusztus 11-én élesedő fejlesztések között még ez a szolgáltatás nem válik elérhetővé.

A fejleményekről a megszokott kommunikációs csatornákon tájékoztatjuk Ügyfeleinket.

### Egy üzenetben jelenthető ügyletek számának növelése

Nemcsak a KSZRF által generált jelentések, hanem minden más (OTC) jelentések esetében a collateral és valuation üzenetek esetében a jelenlegi 100-nál magasabb lesz az egy fájlban jelenthető ügyletek száma.

A jelentések során használható fájl méret a REGIS-TR részéről került korlátozásra. Mivel azonban a collateral és valuation riportok kevesebb adatot tartalmaznak mint például a Reported Trade üzenetek, ezért látunk lehetőséget a korábbi 100-as korlát megemelésére. (Jelenleg teszteljük a lehetséges értéket, de várhatóan a 100-as érték 300-ra kerül megemelésre).

#### Összefoglalva a fentieket:

- A KSZF, a klíringtag és megbízója közötti ügyletek esetében az ügyletek lejelentése mellett a pozíciók lejelentéséhez szükséges jelentéseket is meggenerálja (Reported Trade, Trade Compression, Reported Trade (position));
- A NFC- ügyfeleknek sem a biztosítéki sem az ügyletek értékelésére vonatkozó adatokat nem kell jelenteni, ezért erre vonatkozóan nem kerül információ megadásra a meggenerált jelentésekben;
- Az FC megbízók esetében szükséges a biztosíték érték megadása a jelentésekben, mivel ezeket a KSZF nem ismeri, ezért ő ezen adatok nélkül generálja meg a jelentéseket és külön fájlban teszi ezeket elérhetővé;
- Az FC megbízóknak az ügyletek értékelését, változás esetén, napi szinten jelenteniük kell, mivel erre vonatkozóan a KSZF számára minden információ elérhető, azért a KSZF meggenerálja ezen jelentéseket
- A KSZF és klíringtag közötti ügyletek esetében a KSZF automatikusan jelenti mind a biztosítéki, mind az ügyletek értékelésére vonatkozó jelentéseket.
- A KSZF várhatóan augusztus végével lehetővé teszi az ezt igénylő ügyfelek számára, hogy az általa meggenerált jelentéseket nem csak a KID-en keresztül teszi elérhetővé, hanem igény alapján automatikusan feltölti a KELER Trade Reporting rendszere felé;
- A collateral és valuation jelentések esetében a jelenlegi 100-nál magasabb lesz az egy fájlban szerepelhető jelentések száma.

## Számlázás

A KELER Trade Reporting szolgáltatásával kapcsolatban eddig csak a havi tagsági díjak kerültek kiszámlázásra, a jelentési és nyilvántartási díjak nem.

Ennek legfőbb oka, hogy egyrészt a REGIS-TR is csak április végével küldte meg az első időszakra vonatkozó számlát, másrészt a kapott számla és a KELER Trade Reporting rendszer nyilvántartása között jelentős különbségek voltak.

Az adatok rekosziliálása az elmúlt hónapok során megtörtént, véglegesítettük a jelentési és nyilvántartási díjak mértékét, ezért a következő hónapban februárig visszamenőleg a hiányzó díjak a következők szerint kiszámlázásra kerülnek:.

- minden olyan jelentett ügylet (Reported trade) után, amely nem került napon belül Trade Cancellation üzenettel törlésre 6 Ft, illetve
- minden 2014. május 11-e után jelentett Backloading jelentés után szintén 6 Ft jelentési díj, valamint;
- minden legalább egy 1 napig élő ügyletként nyilvántartásba került ügylet után, nyilvántartási díj címen 10 Ft kerül felszámításra.

## ÚJ FUNKCIÓK A FELÜLETEN

### Tranzakció monitoring

A Tranzakció monitoring felületen a felhasználók a Trade Reporting rendszerbe feltöltött jelentésállományok listáját, illetve a jelentésállományok főbb jellemzőit tekinthetik meg. (Többek között a kereskedési adattár által visszaigazolt jelentés állomány szintű státuszt is.)

A feltöltött állományok közötti keresést, valamint a megjelenített állományhalmaz további szűkítését a szűrő mezők segítik. A rendszerbe bejelentkezett felhasználó alapértelmezetten csak azon partnerhez kapcsolódó jelentésállományokat láthatja, akihez tartozó felhasználóként bejelentkezett.

A felhasználó által feltöltött jelentések, illetve a felhasználó által képviselt partnert érintő, más Ügyfél által előállított rekordok a tranzakció monitoring felületen láthatók.

## Tranzakció monitoring

## Trade Reporting Rendszer

Tranzakció monitoring

	Feltöltés azonosító	Csatorna	Tranzakció feladás időpontja	Tranzakció típusa	Megbízott	Feltöltő személy	Státusz
	3823	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 16. 11:13:...	Feltöltés	RepParticipant1	Szarka Gergely	TR által hibásnak jelölt
	3795	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 13. 14:17:...	Feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által visszaigazolt
	3774	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 11. 15:19:...	Visszamenőleges feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által hibásnak jelölt
	3770	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 11. 14:02:...	Visszamenőleges feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által hibásnak jelölt
	3769	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 11. 13:50:...	Feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által hibásnak jelölt
	3768	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 11. 13:13:...	Feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által visszaigazolt
	3753	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 10. 11:49:...	Feltöltés	RepParticipant1	Szarka Gergely	TR által hibásnak jelölt
	3749	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 05. 16:16:...	Visszamenőleges feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által hibásnak jelölt
	3748	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 05. 16:07:...	Visszamenőleges feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által hibásnak jelölt
	3748	Webről partner által feltöltöt...	2014. 08. 05. 16:05:...	Visszamenőleges feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	Beérkezett hibás

[ 01 - 100 / 745 ]

Újraküldés    Lekérdezés indítása    Jelentések megtekintése

1. ábra Tranzakció monitoring képernyő

A találati listában lévő tételhez kapcsolódó „Tranzakciós fájl napló” ikonra kattintva a fájlal kapcsolatos tranzakció napló jelenik meg.

A „TR adatlekérdezés” ikonra kattintva a felhasználót a tranzakciós adatlekérés ablakra navigálja a rendszer, ahol lekérheti a fájlok tartalmát, ahol letölthetővé válnak mind a küldés és mind a válasz állományok.



A „letöltés” ikonra kattintva a küldés oldali állományokat tekinthetjük meg. A „letöltés” és „válasz letöltés” gombok abban az esetben aktívak,

- ha a jelentésállomány a bejelentkezett felhasználóhoz kapcsolódó partner bármely felhasználója által lett feltöltve, vagy
- ha a jelentésállományt más partner töltötte fel a rendszerbe, de abban csak a feltöltő és a bejelentkezett felhasználó partnere között megkötött ügyletek szerepelnek.

Amennyiben a jelentésállomány „csv” formátumban került feltöltésre, akkor a letöltés gombra kattintva a rendszer megkérdezi, hogy az eredeti CSV formátumban vagy az üzenetkommunikációs elvárások miatt XML formátumúra változtatott állomány töltődjön le.

### Jelentés monitoring

A Jelentés monitoring a Trade Reporting rendszerbe feltöltött jelentésállományok „batch”-jellegű kezelésén túl lehetőséget biztosít a beküldött jelentések tételenkénti monitorozására, visszakeresésére és lekérdezésére. A felület egyaránt elérhető a Tranzakció monitoring felületről a „Jelentések megtekintése” nyomógombra kattintva és külön a „Jelentés monitoring” menüpontból.

A Tranzakció monitoring felület bal oldalán található  és  ikonokra kattintva végezhető el a jelentés-szinten lekérdezendő Jelentésállományok köre. A felhasználó eldöntheti, hogy egy tranzakció tartalmát vagy esetleg több tranzakció adatát kívánja megtekinteni.

Tranzakció monitoring Trade Reporting Rendszer

Tranzakció monitoring

	Feltöltés azonosító	Csatorna	Tranzakció feladás időpontja	Tranzakció típusa	Megbízott	Feltöltő személy	Státusz
	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
	3814	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 14. 10:09:...	Visszamenőleges feltöltés	RepParticipant1	Halász Máté	TR által visszaigazolt
	3811	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 13. 18:53:...	Feltöltés	RepParticipant1	Szarka Gergely	TR által visszaigazolt
	3810	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 13. 18:09:...	Feltöltés	RepParticipant1	Szarka Gergely	TR által visszaigazolt
	3809	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 13. 18:00:...	Feltöltés	RepParticipant1	Szarka Gergely	TR által hibásnak jelölt
	3808	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 13. 14:05:...	Feltöltés	RepParticipant1	Szarka Gergely	TR által visszaigazolt
	3805	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 13. 13:54:...	Feltöltés	RepParticipant1	Szarka Gergely	TR által hibásnak jelölt
	3589	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 09. 15:34:...	Feltöltés	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által visszaigazolt
	3585	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 09. 15:10:...	Trade Termination	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által visszaigazolt
	3584	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 09. 15:09:...	Trade Termination	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által visszaigazolt
	3581	Webről partner által feltöltöt...	2014. 05. 09. 13:32:...	Trade Compression	RepParticipant1	Magony Viktor	TR által visszaigazolt

[ 121 - 130 / 745 ]

Újraküldés Lekérdezés indítása Jelentések megtekintése

2. ábra Jelentésállomány kijelölése Tranzakció monitor felületen

Természetesen a jelentésállományok köre a megjelenített jellemzőkre történő szűréssel is módosítható:

Tranzakció monitoring Trade Reporting Rendszer

Tranzakció monitoring

	Feltöltés azonosító	Csatorna	Tranzakció feladás időpontja	Tranzakció típusa	Megbízott	Feltöltő személy	Státusz
	<input type="text" value="4020"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
	4020	Webszervízen keresztül	2014. 07. 09. 11:07:...	Feltöltés	KSZF	AS_APPSERVER	TR által visszaigazolt

[ 1 - 1 / 1 ]

Újraküldés Lekérdezés indítása Jelentések megtekintése

3. ábra Feltöltés azonosító alapján szűkített tranzakció lista

A megfelelő jelentésállományok kiválasztását követően a „Jelentések” megtekintése” nyomógombra kattintva megjelennek a kijelölt állományok tételei soronként, táblázatos formába rendezve. A megjelenő „Tranzakció monitoring> Tranzakció tételei” képernyő felépítése és funkcionálitása megegyezik a „Jelentés monitoring” menüpontból indított monitorozó felülettel azzal a kivétellel, hogy a Tranzakció tételei felületen csak a kiválasztott tranzakció elemein túl nem bővíthető a jelentések kijelölése.

Tranzakció monitoring

Trade Reporting Rendszer

Tranzakció monitoring > Tranzakció tételei

	Feltöltés azonosító	Tranzakció típusa	Trade ID	InterimTrade Id	Message Id	Partner kód	Másik partner kód	Jelentés státusz	Tranzakció
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	529900MHIW8Z8OTOAH28	5299008ACZ42FL2X1P48	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	5299008ACZ42FL2X1P48	529900MHIW8Z8OTOAH28	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	529900MHIW8Z8OTOAH28	5299008ACZ42FL2X1P48	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	5299008ACZ42FL2X1P48	529900MHIW8Z8OTOAH28	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	529900MHIW8Z8OTOAH28	5299008ACZ42FL2X1P48	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	5299008ACZ42FL2X1P48	529900MHIW8Z8OTOAH28	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	5299008ACZ42FL2X1P48	529900MHIW8Z8OTOAH28	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	5299008ACZ42FL2X1P48	529900MHIW8Z8OTOAH28	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	5299008ACZ42FL2X1P48	529900MHIW8Z8OTOAH28	TradeStatus	TR által
	4028	Feltöltés	000KCCP000S2014083...		529900MHIW8Z8OTOAH	5299008ACZ42FL2X1P48	529900MHIW8Z8OTOAH28	TradeStatus	TR által

[ 1 - 10 / 180 ]

Letöltés    Lekérdezés indítása    Vissza

4. ábra Tranzakció tételeinek megjelenítése - Jelentés monitoring felület

Jelentés monitoring

Trade Reporting Rendszer


Jelentés monitoring

	Feltöltés azonosító	Tranzakció típusa	Trade ID	InterimTrade Id	Message Id	Partner kód	Másik partner kód	Jelentés státusz	Tranzakció
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	9999201310010000000	8888201310010000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	8888201310010000000	9999201310010000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	9999201310010000000	8888201310010000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	8888201310010000000	9999201310010000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	9999201310010000000	8888201310010000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	8888201310010000000	9999201310010000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	9999201310010000000	8888201310010000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	8888201310010000000	9999201310010000000	TradeStatus	TR által
	4044	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	8888201310010000000	9999201310010000000	TradeStatus	TR által
	4044	Feltöltés		ITI100000000000min...	message000000000mi...	8888201310010000000	9999201310010000000	TradeStatus	TR által

[ 21 - 30 / 592 ]

Letöltés    Lekérdezés indítása

5. ábra Jelentés monitoring felület menüpontból indítva

A listázásra kerülő tételek adatai oszlopos elrendezésben kereshető, szűrhető és rendezhető formában láthatók.. A fixen megjelenített oszlopokon felül a táblázat újabb oszlopokkal bővíthető és ezek el is rejthetők. Bejelentkezéskor az alapértelmezett oszlopok kerülnek megjelenítésre a listában azonban a bal felső sarokban található  funkció gomb segítségével bővíthető. A felső sorban található „pipával” a lista a felajánlott összes oszloppal bővíthető.

Oszlop választás
✕


✓	Oszlop név
✗	Utolsó sikeres tranzakció típusa
✗	Bróker
✗	Klíring tag
✗	Eladó/Vevő
✗	Eszközosztály
✗	Termékezonosító1
✗	Termékezonosító2
✗	OTC/ETD (Venue)
✗	Névérték
✗	Hatálybalépés napja
✗	Lejárat napja
✓	Szerződő fél
✓	Másik szerződő fél
✗	Ügylettörítés napja
✗	Tranzakció azonosító
✗	Jelentés feladás időpontja
✗	Hiba ok
✗	Hiba leírás
✗	Szerződés státusz
✗	Reconciliation státusz
✗	Delegation státusz
✗	Visszaigazolt tranzakció típus
✗	Delegation státusz
✗	Visszaigazolt tranzakció típus

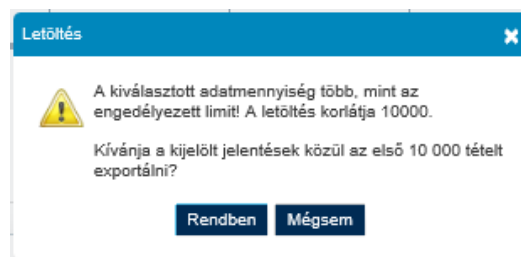
6. ábra További megjeleníthető információk köre - Jelentés monitoring

A táblázatos megjelenítés alapértelmezett és bővített jelentés-adat szintjén a jelentések kereshetősége és állapotuk áttekintése szempontjából feltétlen szükséges mezők és státuszjellemzők érhetők el. A jelentésekben beküldött minden adat nem kerül megjelenítésre a felületen.

A „Partner kód” és „Másik partner kód” mezőkben a keresett partnerekre LEI, BIC vagy COD azonosító alapján indítható keresés, a partnerazonosító típusát külön mezőben nem kell megadni.

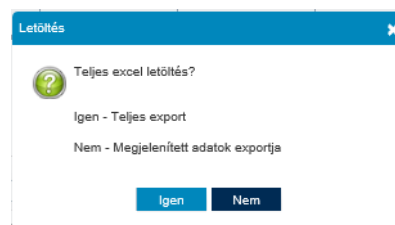
A Trade Reporting rendszer lehetőséget biztosít a Jelentés monitoring felületen lekérdezett és megjelenített jelentések minden adatának excel táblázatba történő exportjára.

A kijelölt jelentések exportja a  gombra kattintva indítható el, ekkor a rendszer megvizsgálja a lekérdezett tételek számosságát. Amennyiben a letöltés a rendszer központi paramétereiben meghatározottnál nagyobb tételszámú jelentés lekérdezését eredményezi, a rendszer a keresési feltételek módosításával lehetővé teszi a lekérdezett jelentések számának csökkentését. A további szűrés nélküli jóváhagyást követően a lekérdezett jelentések közül a paraméterben meghatározottaknak megfelelő számosságú jelentés exportját indítja el a rendszer.



7. ábra Maximális jelentésszám vizsgálat eredmény jelzése

A döntést követően további üzenetablak jelenik meg a felületen, amelyben meghatározható, hogy milyen mélységű adatokat exportáljon a rendszer.



8. ábra Export-típus választó képernyő

A két exportálási lehetőség értelmezése:

**Teljes export:** A jelentés megtekintése felületen kilistázott jelentések exportálása esetén minden üzleti mezőjel exportálásra kerül. Teljes export esetén az üzleti mezők alapvetően a beküldött jelentés adat-sorrend logikája alapján épülnek fel, illetve kiegészülnek a REGIS TR által megküldött státuszinformációkkal és a Trade riporting rendszer által generált jelentés információval (PI: A jelentést tartalmazó állomány Trade Reporting rendszerbeli azonosítója)

**Megjelenített adatok exportja:** A jelentések megtekintése felületen oszlopként látható jelentés mezőket megjelenítve állít elő xlsx állományt.

Az állományban a különböző típusú jelentések adatai külön munkalapon jelennek meg.

### Ügylet monitoring

Az ügyletnyilvántartó célja, hogy a 'tradereporting' vagy 'backloading' üzenetkommunikációval / állomány feltöltéssel lejelentett ügyletek aktuális üzleti állapotát és státuszát megjelenítse, valamint a kapcsolódó jelentések historikus áttekinthetőségét biztosítsa. A funkció az összes KELER felé küldött új ügyletkez kapcsolódó jelentést táblázatos formában tartalmazza. A táblázat elemei kereshetők, oszlopai szerint szűrések, rendezések indíthatók.

A táblázat az ügyletek aktuális üzleti státuszát és jelentések szerinti főbb adatait tartalmazza. A felsorolásban található azon oszlopok, amivel a listákat bővíthetők, illetve amikből kikerülhetnek a fixen megjelenített oszlopok.

A nyilvántartás kezdő oldalán csak a sikeres 'tradereporting' és 'backloading' típusú jelentésfeladásokban felvett ügyletek adatai érhetők el.

Az „Ügylet monitoring” menüpontra kattintva alapértelmezetten üres ügyletlista jelenik meg.

Ügylet monitoring Trade Reporting Rendszer

Ügylet monitoring

	Feltöltés azonosító	Tranzakció típusa	Trade ID	InterimTrade id	Message id	Partner kód	Másik partner kód	Jelentés státusz	Tranzak
Nincs egyetlen megjelenítendő elem sem!									
[ 0 - 0 / 0 ]									
<a href="#">Lekérdezés indítása</a>									

9. ábra Alapértelmezett Ügylet monitoring felület

A keresési feltételek megadásával és a „Lekérdezés indítása” nyomógomb használatával válnak elérhetővé a vizsgálni kívánt ügyletek.

Minden lekérdezett és Regis-TR részéről visszaigazolt ügylet egy sorban jelenik meg abban az esetben is, ha az adott 'tradeID' vagy 'interimTradeId' értékkel többször kíséreltek meg jelentést feltölteni.

## Ügylet monitoring

## Trade Reporting Rendszer

Ügylet monitoring

	Feltöltés azonosító	Tranzakció típusa Feltöltés	Trade ID	InterimTrade Id	Message Id	Partner kód 8882013100100000000	Másik partner kód	Jelentés státusz	Tranzakció
	4098	Feltöltés	HMXWHWZUN2014070:		MO12Y2014002_HM	8882013100100000000	259400ZMS89XVADQSD46	TradeStatus	TR által
	4084	Feltöltés	1070000238a2b8c28b...		MESSAG2340445258	8882013100100000000	259400ZMS89XVADQSD46	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		IT1100000000000minta_0709_18	pe000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4045	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4044	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4044	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4044	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4044	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által
	4044	Feltöltés		IT1100000000000min...	message000000000mi...	8882013100100000000	9992013100100000000	TradeStatus	TR által

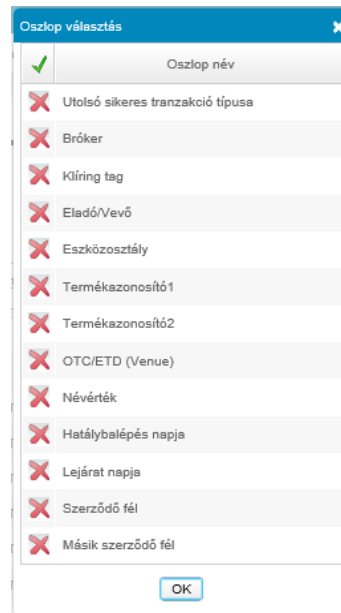
Lekérdezés indítása

10. ábra Feltételek alapján lekérdezett ügyletlista


Az ügyletnyilvántartó nem vizsgálja, hogy a felsorolt jelentések milyen ügyleti státuszban vannak (visszavont, lejáratott vagy magától lejárt ügylet), viszont ezek beazonosításához szükséges jellemzők a felületen szabadon választható mezők között elérhetők, többek között a 'maturity date', 'contract status', 'reconciliation status' mezőkre is indítható szűrés és keresés.

Amennyiben az eredetileg beküldött 'ReportedTrade' vagy 'Backloading' jelentésben megjelölt ügyletazonosítóra további életciklus üzenetek érkeztek (Például: Modification, TradeTermination, stb.), akkor az „Utolsó sikeres tranzakció típusa” mezőben ezek közül a legutolsó típusa kerül megjelölésre, amely szintén egy lekérdezhető ügylet-jellemző.

A „Partner kód” és „Másik partner kód” mezőkben a keresett partnerekre LEI, BIC vagy COD azonosító alapján indítható keresés, a partnerazonosító típusát külön mezőben nem kell megadni.



11. ábra További megjeleníthető információk köre

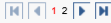
Az „ügylet történet”  ikonra kattintva az „Ügylet monitoring” felületen válnak láthatóvá az adott trade-re vonatkozó tranzakciók kronológiai sorrendben. Az „Ügylettörténet” képernyő mind a „Jelentés monitoring”, mind az „Ügylet monitoring” felületről elérhető.

## Ügylet monitoring

Ügylet monitoring > Ügylet történet

## Trade Reporting Rendszer

	Feltöltés azonosító	Tranzakció típusa	Trade ID UTI00000000v10mintaz2	InterimTrade Id	Message Id	Partner kód	Másik partner kód	Jelentés státusz	Tranzakció
	3981	Feltöltés	UTI00000000v10min...		message00036100mi...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	TR által
	3981	Feltöltés	UTI00000000v10min...		message00036100mi...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	TR által
	3976	Trade megszüntetés	UTI00000000v10min...		message000000ca0mi...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	TR által
	3976	Trade megszüntetés	UTI00000000v10min...		message000000ca0mi...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	TR által
	3963	Módosítás	UTI00000000v10min...		message020783:200m...	88882013100100000000	99992013100100000000	MessageRejected	TR által
	3963	Módosítás	UTI00000000v10min...		message020783:200m...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	TR által
	3962	Módosítás	UTI00000000v10min...		message000783:200m...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	Béérkez
	3961	Módosítás	UTI00000000v10min...		message000783:000m...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	Béérkez
	3922	Trade Termination	UTI00000000v10min...		message000007770mi...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	TR által
	3922	Trade Termination	UTI00000000v10min...		message000007770mi...	88882013100100000000	99992013100100000000	TradeStatus	TR által

[ 1 - 10 / 12 ] 

Letöltés Lekérdezés indítása Vissza

12. ábra Ügylet történet felület

Az „Ügylet monitoring” képernyőn az adott ügyletnek tartozó egyes jelentésekhez kapcsolódóan 2-2 sor jelenik meg minden esetben, ahol az első sor a jelentés fogadását és a REGIS TR felé történő feladását jelöli, míg a második sor a kapott státuszt és már a REGIS TR kommunikáció lezárását is jelöli.

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](mailto:csiszer.peter@keler.hu)**Banadics Iván**

osztályvezető

Stratégiai és Termékmenedzsment Osztály

Tel: (+36 1) 483 – 6284

E-mail: [banadics.ivan@keler.hu](mailto:banadics.ivan@keler.hu)**Szarka Gergely**

termékmenedzser

Stratégia és Termékmenedzsment Osztály

Tel: (+36 1) 483 – 6213

E-mail: [szarka.gergely@keler.hu](mailto:szarka.gergely@keler.hu)**Nyíri Szabolcs**

osztályvezető

Ügyfélkapcsolati és Marketing Osztály

Tel: (+36 1) 483 – 6187

E-mail: [nyiri.szabolcs@keler.hu](mailto:nyiri.szabolcs@keler.hu)**Központi e-mail cím:** [tradereporting@keler.hu](mailto:tradereporting@keler.hu)

Budapest, 2014. július 20.