

Ügyféltájékoztató

Az EMIR-ben meghatározott derivatív ügyletek
jelentési kötelezettségéről VIII.

2014. szeptember 22.

TISZTELT ÜGYFELEINK

Ezúton szeretnénk tájékoztatni Önöket a KELER Trade Reporting szolgáltatásával kapcsolatos legfrissebb információkról, változásokról.

KELER KSZF ÁLTAL ELŐÁLLÍTOTT JELENTÉSE AUTOMATIKUS FELTÖLTÉSE

A KELER KSZF Zrt. (KSZF) a Budapesti Értéktőzsdén kötött ügyleteket tekintetében az ezt igénylő klíringtagok számára előállítja és az eddigi gyakorlatnak megfelelően a KID-nek keresztül elérhetővé teszi a Klíringtag és megbízója közötti ügyletek lejelentéséhez szükséges riportokat.

Az így meggenerált jelentéseket (CSV fájlokat), a KID-ről történő letöltését követően fel kellett tölteni a KELER Trade Reporting rendszerébe, annak érdekében, hogy az EMIR-ben előírt jelentési kötelezettség teljesítésre kerüljön.

A KSZF legújabb fejlesztésének köszönhetően 2014. szeptember 29-től kezdődően, azt ezt igénylő ügyfelek számára, lehetőséget biztosítunk arra, hogy a nap végével előállított CSV fájlok (klíringtag és megbízó közötti ügyletekre vonatkozóan) automatikusan feltöltésre kerüljenek. Vagyis az automatikus feltöltést választó klíringtagoknak nincs más teendője, mint napi szinten ellenőrizni, hogy a KSZF által feltöltött állományok rendben visszaigazolásra kerültek.

A szolgáltatás gördülékeny bevezetése érdekében az indulást követő első két hétben mi is aktívan ellenőrizni fogjuk, hogy a jelentések rendben visszaigazolásra kerültek.

Alapvetően a KSZF által előállított jelentéseket a KELER Trade Reporting rendszere vagy a REGIS-TR csak abban az esetben utasíthatja vissza, amennyiben olyan megbízó köt ügyletet, akit a Klíringtag KID-en keresztül megbízóként nem jelentett be. Ebben az esetben a KSZF által előállított jelentésben a „Counterparty” rész üresen marad, és ennek hiányában nem kerül a jelentés befogadásra.

Ennek elkerülése érdekében kérjük minden esetben annak ellenőrzését, hogy egy új megbízó a KID-en keresztül (PVE „adatlap”) is bejelentésre került.

Az automatikus jelentés feltöltés igénylésére szolgáló nyilatkozat az alábbi címen érhető el:

<http://www.keler.hu/keler/keler.listhead.news.page?nodeid=2407>

Kérjük a kitöltött nyilatkozatokat aláírva az alábbi címre küldjék:

KELER KÖZPONTI ÉRTÉKTÁR ZRT.

ÜGYFÉLSZOLGÁLAT

BUDAPEST

RÁKÓCZI ÚT 70-72.

1074

Az eddigi gyakorlatnak megfelelően továbbra is a KID-en keresztül (PVE módosítás) kell jelezni, amennyiben egy szereplő nevében a klíringtag vállalta a jelentést. Ebben az esetben a „TR jelentést kér” mezőt is be kell X-elni és a többi adat megadása is szükséges annak érdekében, hogy a jelentésben a szükséges adatok megjelenhessenek. A „TR jelentést kér” mező bejelölésére a magánszemély megbízók esetében nincs szükség, hiszen nekik nem kell a saját nevükben jelenteni, őket elegendő a klíringtag jelentésében feltüntetni.

„COLLATERAL PORTFOLIO CODE” MEZŐ TÖLTÉSE

Az EMIR előírásai alapján augusztus 11-től jelenteni kell az ügyletekhez kapcsolódó biztosítéki értékeket és értékelési adatokat („Collateral and valuation update” riportok.)

A biztosítékra vonatkozó információk megadása csak az FC és NFC+ ügyfelek esetében előírása, az NFC ügyfelek esetében ez nem kötelező.

A KSZF által, klíringtag és megbízója közötti ügyletek lejelentéséhez szükséges CSV fájlok esetében a „Collateral portfolio code” mező is kitöltésre kerül.

A jelenlegi gyakorlat alapján minden esetben a TRTRADEEN és TRTRADEP jelentésekben a „Collateral portfolio code” mezőbe a pozícióvezetési entitás azonosítóját írjuk be (PVE azonosító). Mivel több piaci szereplő is jelezte, hogy számára ez az adat nem ismert, így problémát okoz számra, hogy a biztosíték érték jelentéséhez szükséges Collateral Update (CU) jelentésben ezt a megfelelő megbízókhöz fel tudja tüntetni.

A megoldása érdekében szeptember 20-ával élesítésre kerül az a módosító csomag, ami alapján a KSZF által generált jelentésekben (CSV fájlokba) már nem a PVE azonosító, hanem a klíringtag által adott ügyfélhez megadott Megbízó azonosító fog bekerülni.

PVE módosítása - []

File

Nyomtatás Napló Aláírások Sablon készítése Státusz történet

Csomag neve [] Sz. 1 Elszámolási nap 2014/03/05

Hivatkozási szám [] PVE azonosító []

Alklíringtag [] **Megbízó** [] PVE típus rövid neve Megbízói

Deviza belföldi/külföldi Belföldi Pozícióvezetés módja Bruttó ☒ Aktív ☐ TR jelentést igényel

Orsz. Irányítószám Helységneve [] Utca, házszám []

TR azon.típ. [] TR azonosító [] Pénzügyi jelleg []

Szektorkód []

DER:T Részmenyiség: 1

A módosítás alapján 2014. szeptember 22-től kezdve az FC megbízók esetében a klíringtagok által előállítandó CU üzenetben a Collateral portfolio code mező értékében az adott ügyfél megbízó azonosítóját kell írni, annak érdekében, hogy a CU üzenet a REGIS-TR részéről befogadásra kerüljön.

Összefoglalva: Amennyiben a klíringtag kéri, hogy a KELER automatikusan feltöltse a KSZF által generált jelentéseket, akkor a BÉT-en kötött derivatív ügyletek jelentése kapcsán a klíringtagoknak csupán egy feladata marad, hogy az FC megbízók esetében előállítsa a CU jelentéseket. A CU jelentésekben pedig a Collateral portfolio code mezőbe pedig az adott ügyfél megbízó azonosítóját kell feltüntetni.

TŐZSDEI ÜGYLETEK (TRADE-K) ÉS POZÍCIÓK JELENTÉSE

A REGIS-TR az ESMA-val egyeztetve **változtatott a tőzsdei** (Exchange Traded Derivatives - ETD) **ügyletek** (OTC ügyleteket ez a változás nem érinti) **jelentési folyamatán**, annak érdekében, hogy különbséget lehessen tenni az ügyletek és a pozíciók jelentése között.

A módosítás alapján az alábbi üzenet változnak:

Eddig használt jelentéstípus	Új jelentéstípusok a tőzsdei (ETD) ügyletek jelentése kapcsán
ReportedTrade	ReportedTradeCL
Modification	ModificationCL
TradeCancellation	TradeCancellationCL
TradeCompression	TradeCompressionCL
TradeTermination	TradeTerminationCL

FONTOS: Az új és az eddig használt üzenettípusok között csak a riport első oszlopának (Action Type-s mező) töltésében van különbség, mely alapján például a ReportedTrade helyett az ETD ügyletek jelentések esetében a ReportedTradeCL lesz feltüntetve. A többi üzenettípus esetében is csak ennyi a változás.

A ReportedTradeCL üzenetek esetében a logikai ellenőrzésekben annyi változás történt, hogy az üzenetben **nem lehet Interim Trade Identifier (ITI) használni**, illetve **kötelező a Transaction Reference Number feltüntetése**.

FONTOS: Az ügyletek lejelentését követően (ReportedTradeCL) azok nap végével a CompressionCL üzenettel törlésre kerülnek, jelezve, hogy azok egy pozícióba kerültek összevonásra. **Az így kapott pozíció jelentése már a jelenleg is használt üzenettel, ReportedTrade üzenettel történik meg.** Változás az eddigi gyakorlathoz képest, hogy a pozíciós jelentések esetében nem lehet a „Venue” mező értékét tölteni, valamint a „Compression” mezőhöz „Y” írandó.

A BÉT-en kötött ügyletek kapcsán, a KSZF már a fentieknek megfelelően generálja a jelentéseket, 2014. szeptember 22-től, azaz:

- A TRTRADEK és TRTRADEC jelentések esetében az „Action type mezőbe” már a CL típus kerül beírásra;
- A TRTRADEK és TRTRADEP jelentések esetében a „Collateral portfolio code” mezőbe, a megbízó azonosítója lesz feltöltve;
- A TRTRADEP (pozíciós jelentések) esetében a Compression mező „Y”-el lesz töltve;
- A TRTRADEP jelentésekben a „Venue” mező nem kerül kitöltésre;
- A TRTRADEP jelentések esetében a Transaction reference number nem kerül töltésre.

Mivel az eddigi pozíciós jelentéseket nem a fentiek szerint töltöttük, ezért a KSZF 2014. szeptember 22-én központilag módosítja mind a saját, mind a klíringtagok élő pozíciós jelentéseit.

Az adattisztítás miatt a pénteki napra vonatkozóan csak az ügyletek és azok törléséhez szükséges TRTRADEK és TRTRADEC jelentéseket generáltuk, a pozíciós jelentéseket a hétfői nap folyamán (szeptember 22-én) automatikusan minden klíringtag esetében a KSZF fogja feltölteni.

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

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**TÓTH-BEDE ÉVA**

nemzetközi elszámolási munkatárs

Nemzetközi Elszámolási Osztály

Tel: (+36 1) 483 - 6288

E-mail: toth-bede.eva@keler.hu**NEPPEL PÉTER**

nemzetközi elszámolási munkatárs

Nemzetközi Elszámolási Osztály

Tel: (+36 1) 483 - 6293

E-mail: neppel.peter@keler.hu

Központi e-mail cím: tradereporting@keler.hu vagy servicedesk@keler.hu

Budapest, 2014. szeptember 22.