



keler



## Ügyféltájékoztató

Az EMIR-ben meghatározott  
derivatív ügyletek jelentési  
kötelezettségéről XI.



## TISZTELT ÜGYFELEINK!

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

### „ÚJ” VALIDÁCIÓS SZABÁLYOK

Az alábbi mezők kitöltése kapcsán kerültek új szabályok bevezetésére:

#### 1) *Underlying ID type és Underlying ID mezők:*

Amennyiben a *“Taxonomy used”* mező értéke *“E”* és a *“Product ID 1”* mező értéke *“IR”*, akkor az *“Underlying ID Type”* és *“Underlying ID”* mezők üresen maradhatnak, nem kötelező érték megadása;

Amennyiben a *“Taxonomy used”* mező értéke *“E”* és a *“Product ID 1”* mező értéke *“CO”* vagy *“CU”* akkor az *“Underlying ID Type”* és *“Underlying ID”* mezőket tilos kitölteni.

#### 2) *Kötelezően töltendő mezők*

Új ügyletek jelentésénél (Reported Trade és Reported Trade CL üzenetek esetében) az alábbi mezőket minden esetben tölteni kell:

- Price/Rate mező;
- Clearing obligation mező;
- Compression mező

#### 3) *Kamat derivatívák jelentése*

Amennyiben a *“Taxonomy used”* mező értéke *“E”* és a *“Product ID 1”* mező értéke *“IR”* akkor az alábbi mezők közül legalább az egyiket tölteni kell:

- Fixed rate of leg 1
- Fixed rate of leg 2
- Floating rate of leg 1
- Floating rate of leg 2

Azoknál a speciális termékeknél (például CFD-k esetében), ahol egy adott mező nem értelmezhető, akkor van lehetőség 0%-ot megadni az adott mezőben.

A fenti módosítások igazából már jelenleg is érvényben vannak, így valószínűleg nem jelentenek tényleges változást a napi jelentések során. Ami miatt ismét kiemelésre kerültek, hogy a fenti szabályok éles rendszerben történő ellenőrzésére **2016. április 1-től** kerül sor.

A tesztkörnyezetben már most is élnek ezen új ellenőrzések, így a KELER tesztkörnyezetén keresztül beküldött jelentések már e szabályok figyelembevételével kerülnek jóváhagyásra.

## DELIVERY „TAG” ISMÉTLŐDÉSE

Az áruipiaci derivatívák jelentésénél (energia és gázpiaci ügyletek esetében - Commodity details mező értéke „EL” vagy „NG”) eddig a delivery-re vonatkozó adatokat csak egyszer lehetett megadni.

Az ESMA által jóváhagyott módosítások alapján most már az adott rész 20-szor ismétlődhet egy adott ügylet jelentésén belül.

Az ismétlődés az alábbi mezőket érinti:

- Delivery Start Date
- Delivery End Date
- Contract Capacity
- Quantity Unit
- Price/time interval quantities

CSV formátum esetében az alábbi mezők (rész) kerülnek megismétlésre:

Deliverystarttimestamp	Deliveryendtimestamp	Contractcapacity	Quantityunit	Pricetimeintervalquantities
2016-03-01T06:00:00Z	2018-03-01T06:00:00Z	50000	MWh	20

XML jelentések esetében pedig az alábbiak szerint kerül sor az ismétlődésre:

```
- <trad1:delivery>
  <trad1:deliveryStartTimestamp>2016-03-01T06:00:00</trad1:deliveryStartTimestamp>
  <trad1:deliveryEndTimestamp>2018-03-01T06:00:00</trad1:deliveryEndTimestamp>
  <trad1:contractCapacity>50000</trad1:contractCapacity>
  <trad1:quantityUnit>MWh</trad1:quantityUnit>
  <trad1:priceTimeIntervalQuantities>20</trad1:priceTimeIntervalQuantities>
</trad1:delivery>
- <trad1:delivery>
  <trad1:deliveryStartTimestamp>2018-03-01T06:00:00</trad1:deliveryStartTimestamp>
  <trad1:deliveryEndTimestamp>2019-03-01T06:00:00</trad1:deliveryEndTimestamp>
  <trad1:contractCapacity>50000</trad1:contractCapacity>
  <trad1:quantityUnit>MWh</trad1:quantityUnit>
  <trad1:priceTimeIntervalQuantities>30</trad1:priceTimeIntervalQuantities>
</trad1:delivery>
- <trad1:delivery>
  <trad1:deliveryStartTimestamp>2019-03-01T06:00:00</trad1:deliveryStartTimestamp>
  <trad1:deliveryEndTimestamp>2021-03-01T06:00:00</trad1:deliveryEndTimestamp>
  <trad1:contractCapacity>50000</trad1:contractCapacity>
  <trad1:quantityUnit>MWh</trad1:quantityUnit>
  <trad1:priceTimeIntervalQuantities>40</trad1:priceTimeIntervalQuantities>
</trad1:delivery>
```

A fenti módosítás azt eredményezi, hogy hozzá kellene nyúlnunk a jelenlegi CSV struktúrához, hiszen ennél a maximális oszlopszám meghatározásakor figyelembe kell vennünk a lehetséges ismétlődéseket is. Mivel azonban az EMIR II. miatt úgy is szükség lesz majd módosításokra, ezért azt a döntést hoztuk, hogy a KELER biztosítja a jövőben mind az új, mind a régi CSV fájlok használatát is.

Azaz, azon ügyfelek, akik a jelentéseiket CSV fájlban töltik fel felénk, és élnének a fenti mezők ismétlődésével, azok számára megküldjük az új CSV formát (ami már a kibővített oszlopszámot tartalmazza), és ők ezentúl ezzel az új CSV mintafájl segítségével tudják jelenteni az ügyleteiket. Azon ügyfelek pedig, akiket nem érint a fenti mezők ismétlődése, azok számára semmilyen módosításra nincs szükség, az általuk jelenleg használt CSV minta továbbra is befogadásra fog kerülni.

Az XML jelentések esetében nem jelent gondot az ismétlődések kezelése. A rendszer képes lesz fogadni azon XML alapú jelentéseket, amelyekben az említett mezők ismétlésre kerültek, illetve a CSV-hez hasonlóan a jelenlegi XML fájlok is rendben befogadásra kerülnek majd.

Jelenleg a KELER tesztrendszerébe telepítésre kerültek a fenti módosítások, azonban a CSV-k esetében most csak az új, kibővített oszlopszámú jelentések kerülnek befogadásra. A jövő hét végén kerülhet telepítésre az a fejlesztési csomag, ami a fent leírtak szerint mindkét CSV formát (mai meglévő és az új, ismétlődő mezőket tartalmazót) is kezelni tudja. Az XML alapú jelentések tesztelésére pedig már most is lehetőség van (függetlenül, hogy az említett delivery rész ismétlődésre került vagy sem.)

A delivery alá tartozó mezők ismétlődése az alábbi jelentéstípusokat érinti:

- Reported Trade
- Reported Trade CL
- Modifiation
- Modification CL

Amennyiben a jövő héten tesztre telepítendő csomag esetében valóban megoldott mindkét CSV minta kezelése (meglévő és a kibővített), akkor március végével a csomag élesítésre kerül.

#### **MODIFICATION DATE MEZŐ**

Korábbi tájékoztatóban már jeleztük, hogy az adattár részéről a Modification üzenetek esetében egy új mező, az úgynevezett Modification date mező került bevezetésre

Az új mező kapcsán a KELER részéről automatikusan lefejlesztésre került, hogy minden esetben a jelentés beküldésének dátuma automatikusan beírásra kerül ebbe az új mezőbe, így az üzenet a kereskedési adattár által elvártak szerint kerül továbbításra. Az új mező kapcsán a KELER-en keresztül jelentő ügyfeleknek így semmi tennivalója sincs.

A mező kötelező bevezetése szintén azt eredményezte volna, hogy módosítani kellene a jelenlegi Modification üzenet struktúráján (új CSV és XML sablonok).

Ebben az esetben is azt a megoldást választottuk, hogy lehetővé tettük a mező ügyfél részéről történő kitöltésének lehetőségét is. A KELER tesztrendszerében szereplő jelenlegi verzióban van lehetőség egyrészt az adott mező kitöltésével és kitöltése nélkül is jelentéseket beküldeni.

Az említett március végi élesítést követően pedig az éles rendszer működése is követni fogja ezt a metodikát.

Azaz, amennyiben a Modification üzenetekben a Modification date mező töltésre kerül, akkor ezzel az értékkel kerül a jelentés továbbításra, amennyiben nem kerül érték megadásra a mezőben, akkor a KELER automatikusan a jelentés beküldésnek napját fogja az adott mezőbe betenni.

#### **KELER KSZF ÁLTAL ELŐÁLLÍTOTT JELENTÉSEK**

A fentiekben bemutatott új ellenőrzési szabályok miatti szükséges módosításokat a KELER KSZF az általa előállított jelentések esetében automatikusan elvégzi (mind a KSZF és Klíringtag mind a Klíringtag és Megbízói közötti ügyletek esetében), így ezek kapcsán semmilyen teendője nincs az ügyfeleknek.

#### **EMIR JELENTÉSEK KAPCSÁN MUNKACSOPORT LÉTREHOZÁSA**

Az elmúlt hónap alatt több megkeresés érkezett felénk, hogy bizonyos időközönként érdemes lenne közösen leülni és átbeszélni a fontosabb változásokat.

A KELER nyitott minden ilyen törekvéssel szemben és szívesen megszervezi és koordinálja az ilyen eseményeket.

Ami kapcsán érdemesnek látnánk egy ilyen munkacsoport létrehozást, az egyrészt a jelentések során mindkét fél által használandó egyedi ügyletazonosító (UTI vagy TRADE ID) kialakításának analitikája lenne. Többen jelezték, hogy hasznos lenne a hazai piacon egyfajta standardot kialakítani az OTC ügyletek jelentésekor használandó ügyletazonosító kód esetében, ami alapján mindenki jelenteni tudná az ügyleteket, annak érdekében, hogy azok az adattár által párosíthatóak is lehessenek.

A másik ilyen nagyobb téma pedig az EMIR II. lehetne, ami főleg a jelentési kötelezettség kapcsán jelent újdonságokat. Az ESMA honlapjáról már letölthető egy végleges munkaanyag, mely jelenleg a Bizottság jóváhagyására vár.

A dokumentum az alábbi linken érhető el:

[https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/2015-esma-1645\\_-\\_final\\_report\\_emir\\_article\\_9\\_rts\\_its.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/2015-esma-1645_-_final_report_emir_article_9_rts_its.pdf)

Az említett munkaanyag kapcsán sajnos lesznek módosítások a jelenlegi jelentések felépítésében, és viszonylag sok új mező kerül beillesztésre.

Azt gondoljuk, hogy ezen téma kapcsán is hasznos lenne egy piaci konzultációt tartani.

#### **KAPCSOLATTARTÓ SZEMÉLY MEGADÁSA**

Minden ügyfelünk esetében egy kapcsolattartó személy került induláskor megadásra. Alapvetően az ő szerepe csak annyiban különbözik a többi felhasználótól, hogy a különböző hírlevelek, ügyféltájékoztatók felé kerülnek kiküldésre, illetve az esetleges hibák is felé kerülnek jelzésre.

Az utóbbi időben azt tapasztaltuk, hogy sajnos nem mindig elegendő az egy kapcsolattartó személye, hiszen hosszabb szabadság, betegség vagy egyéb ok miatt nem kerülnek a szükséges információk időben továbbításra. Ráadásul egyes esetekben a korábban megadott kapcsolattartók már nem is dolgoznak az adott cégnél.

Kérjük, a fentiek alapján a [tradereporting@keler.hu](mailto:tradereporting@keler.hu) e-mail címére küldjék meg a jelenlegi kapcsolattartó és egy újonnan rögzítendő kapcsolattartó adatait (név, e-mail cím, telefonszám megadásával). A jövőben minden fajta kommunikáció feléjük kerül megküldésre.

A kapcsolattartó adatain kívül kérjük, azt is jelezzétek felénk, hogy a fent említett munkacsoport kialakítását hasznosnak találják-e vagy sem.

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

**TÓTH-BEDE ÉVA**  
nemzetközi elszámolási munkatárs  
Nemzetközi Elszámolási Osztály  
Tel: (+36 1) 483 - 6288  
E-mail: [toth-bede.eva@keler.hu](mailto:toth-bede.eva@keler.hu)

**SZARKA GERGELY**  
termékmenedzser  
Stratégiai és Termékmenedzsment Osztály  
Tel: (+36 1) 483 - 6213  
E-mail: [szarka.gergely@keler.hu](mailto:szarka.gergely@keler.hu)

Központi e-mail címek: [tradereporting@keler.hu](mailto:tradereporting@keler.hu) vagy [servicedesk@keler.hu](mailto:servicedesk@keler.hu)