

Ügyféltájékoztató

a Trade Reporting szolgáltatás, APA
jelentésekkel kapcsolatos módosulásáról

2024. július 16.

Tisztelt Ügyfeleink!

Ezúton tájékoztatjuk Önöket, hogy az ESMA által kiadott, a MiFIR RTS1 és RTS2 rendeletekre vonatkozó módosítások alapján a TR rendszert érintő fejlesztések véglegesítésre kerültek.

A kereskedés utáni közzétételre vonatkozó módosítások következtében:

- mezőkötelezőségek változnak,
- új mezők kerülnek bevezetésre,
- bizonyos mezők töltése feltételhez kötötté válik,
- új validációs szabályok kerülnek bevezetésre , és
- egyes mezők (flag) értékkészlete megváltozik.

A riportokat XML formátumban kérjük megküldeni.

Az új elvárásokkal kapcsolatos megfelelést a KELER 2024.09.21 nappal tervezi életbe léptetni.

A fentiekkel kapcsolatos kérdéseiket kérjük a tradereporting@keler.hu címre küldjék meg.

Üdvözlettel:

KELER Zrt.

KELER TR által befogadott, illetve a BÉT felé küldött APA (post-trade transparency) jelentések sablonja az alábbiak szerint módosítandó (változások pirossal):

	Mező elnevezése	Érintett termékkör	Kötelezően töltendő	Megjegyzés
1	Trading date	All	Alapesetben a mező megadása kötelező - a későbbiekben kifejtésre került, hogy mely esetben lehet mégis üresen hagyni	A nyilvánosságra hozatal során az ügylekötés dátumát és időpontját UTC-időben kell megadni. A KELER elvégzi a szükséges "idő konverziókat" ezért az ügyfeleknek mindig a náluk érvényes helyi idő szerinti időpontot kell megadni. A kereskedési helyszínen kívül végrehajtott ügyletek esetében azt a dátumot és időpontot kell megadni, amikor a felek megállapodtak a következő adatmezők tartalmáról: mennyiség, árfolyam, pénznem, eszközazonosító kód, eszközkategória, valamint adott esetben az alapeszköz kódja. A kereskedési helyszínen kívül végrehajtott ügyletek esetében az időpontot legalább egy másodperc pontossággal kell megadni.
2	Trading time			A publikálás során összevontan kerül megadásra az időpont (date and time mező egyben)
3	Intrumentum identifier type	All	Alapesetben a mező megadása kötelező - a későbbiekben kifejtésre került, hogy mely esetben lehet mégis üresen hagyni	„ISIN” = ISIN-kód, amennyiben rendelkezésre áll „OTHR” = egyéb azonosító Equity típusú termékek esetében csak ISIN lehet
4	Intrumentum ID	Non-equities	Csak Non-equity ügyletek esetében	
5	Price	All	Nem	Ha az árfolyam nem áll rendelkezésre, az a mező 0-val tölthető - „PNDG” és „NOAP” érték nem adható meg.
új	Missing price	All	Nem	Ahol az árfolyam még nem áll rendelkezésre (függőben van), ott „PNDG” érték szerepeltetendő. Ahol az árfolyam nem alkalmazandó, ott „NOAP” értékkel töltendő ez a mező. A mező nem tölthető, ha a Price mező töltve van 0-tól eltérő értékkel. Ha a „price” mező 0-val töltött, vagy értéke NULL, akkor a „missingPrice” mező értéke csak „PNDG” vagy „NOAP” lehet.
6	Price notation	All	Nem	Amennyiben az árfolyam rendelkezésre áll. MONE, PERC, YIEL, BAPO

7	Price currency	All	Nem	Az a devizanem, amiben az árfolyam ki van fejezve. Validációs szabály szükséges: abban az esetben tölthető, ha az árfolyam monetáris értékben van kifejezve, tehát a "price" mező töltött.
8	Quantity	All	Minden pénzügyi eszközre, kivéve az RTS2 11 (1) cikk (a) és (b) pontjában felsoroltak.	Validációs szabály szükséges: halasztott közzététel (Trade Publication indicator=2) esetén nem kötelező
9	Quantity notation	Commodity derivatives, emission allowances and their derivatives	Commodity ügyletek esetében a mező magadása kötelező - kivéve az RTS2 11 (1) cikk (a) és (b) pontjában felsoroltak.	commodity ügyleteknél kötelező, ha nem halasztott a közzététel Validációs szabály szükséges: Trade Publication indicator=1 és Derivatives type=COMM vagy EMAL esetén ez a mező kötelezően töltendő
10	Quantity unit	Commodity derivatives, emission allowances and their derivatives	Commodity ügyletek esetében a mező magadása kötelező - kivéve az RTS2 11 (1) cikk (a) és (b) pontjában felsoroltak.	commodity ügyleteknél kötelező, ha nem halasztott a közzététel Validációs szabály szükséges: Trade Publication indicator=1 és Derivatives type=COMM vagy EMAL esetén ez a mező kötelezően töltendő
11	Notional amount	Non-equities	Csak Non-equity ügyletek esetében - kivéve az RTS2 11 (1) cikk (a) és (b) pontjában felsoroltak.	non-equity ügyleteknél kötelező, ha nem halasztott a közzététel Validációs szabály szükséges: Trade Publication indicator=1 és Product type=SDRV/SFPS/BOND/ETCS/ETNS/EMAL/DERV esetén kötelezően töltendő
12	Notional currency	Non-equities	Csak Non-equity ügyletek esetében - kivéve az RTS2 11 (1) cikk (a) és (b) pontjában felsoroltak.	non-equity ügyleteknél kötelező, ha nem halasztott a közzététel Validációs szabály szükséges: Trade Publication indicator=1 és Product type=SDRV/SFPS/BOND/ETCS/ETNS/EMAL/DERV esetén kötelezően töltendő
13	emissionAllowancesType	Emission allowances and their derivatives	Csak emisszió ügyletek esetében	
14	Execution venue	All	Igen	OTC ügylet esetében XOFF, amennyiben az egyik fél rendszeres internalizáló akkor SINT érték lehet
új	Third-country trading venue of execution	All	Amennyiben az ügylet harmadik országbeli kereskedési helyszínen kötött.	MIC kód vagy országcód Validációs szabály szükséges: Ez a mező csak akkor tölthető, ha az Execution venue "XOFF".
15	Transaction to be cleared flag	Derivatives	Csak derivatívák esetében	„igaz” – ha az ügylet elszámolásra kerül „hamis” – ha az ügylet nem kerül elszámolásra
16	Publication date	All	-	APA által kerül kitöltésre (A publikálás során összevontan kerül megadásra az időpont (date and time egyben))
17	Publication time		-	APA által kerül kitöltésre
18	Publication venue	All	-	APA által kerül kitöltésre (KELER MIC kódja lesz)

19	Transaction identifier code (TIC)	All	-	APA által kerül kitöltésre
20	Original Trade ID	All	Igen	A befektetési vállalkozás belső egyedi ügyletazonosítója. Ennek megadása segíti a rekonsziliálást, hiszen így könnyebben összevezethető, hogy melyik ügylet milyen azonosítóval (TIC kóddal) került publikálásra. Összevont ügyletjelentés esetén egy egyedi érték megadása kötelező.
21	Action type	All	Igen	A megküldött jelentés típusát mutatja. Lehetséges értékek: N: új ügylet esetén; C: korábban publikált ügylet törlése esetén; M: korábban lejelentett ügylet módosítása esetén.
22	Duplicative indicator	All	Igen	Annak jelzése, hogy a publikálandó jelentés más APA-n keresztül korábban már publikálásra került-e vagy sem.
23	Product type	All	Igen	A MIFID II. alapján meghatározott terméktípus megadása. Az ebben a mezőben szereplő érték adja meg, hogy részvény típusú vagy nem-részvény típusú ügyletről van szó. A KELER ez alapján ellenőrzi, hogy mely mezők megadása elvárt az 1-19 mezők esetében.
24	Derivatives type	Non-equities	Csak derivatívák esetében	A derivatívák vagy emissziós ügylet esetébe az ügylet altípusának megadására szolgáló mező (A product type mezőbe a következő érték valamelyike került megadása: SDRV, DELV, EMAL) Validációs szabály szükséges: amennyiben a Product type mező SDRV/DELV/EMAL értékkel van töltve, ez a mező is kötelezően töltendő
25	Sell/Buy indicator	All	Nem	Annak megadása, hogy a jelentést beküldő fél eladó vagy vevő volt az ügyletben
26	Counterparty ID type	All	Nem	Az ügyletben résztvevő másik fél azonosítójának típusa (COD vagy LEI)
27	Counterparty ID	All	Nem	Maga a konkrét érték, amennyiben a Counterparty ID type mező értéke COD, akkor ez a mező üresen hagyható.
28	Agency Cross Trade	All	Nem	"ACTX" Flag - azon ügyletek, amelyek esetében egy befektetési vállalkozás a vétel és az eladás keretében két ügyfélmegbízást egyetlen ügyletként, azonos volumen és árfolyam mellett hajt végre
29	Benchmark indicator	All	Nem	"BENC" Flag - minden típusú volumennel súlyozott átlagolás ügyletek és minden más olyan kereskedés, amely esetében az árfolyamot egy adott referencia szerint számos időpont alapján számítják ki.

30	Trade Type	All	Nem	Fizikai teljesülésre vonatkozó flag megadása. Melynek értékei: "TPAC" - fizikai teljesítéstől függő (EFP) ügyletnek nem minősülő ügyletsomagok "XFPH" - fizikai teljesítéstől függő (EFP) ügylet
31	Trade Price Condition	All	Nem	Az árral kapcsolatos adatok megadása: Nem árképző tranzakciókra vonatkozó flag-ek: "NPFT" - Nem árképző ügylet jelzése; "SDIV" - Speciális osztalékügylet jelzése; "RPRI" - Árjavítással végrehajtott ügylet jelzése; "TNCP" - Árfeltárási folyamathoz hozzá nem járó ügyletek jelzése "PORT" - Portfolio transactions "CONT" - Contingent transactions
32	Trade Publication indicator	All	Nem	Ebben a mezőben lehet megadni, hogy a KELER felé megküldött jelentés: 0= ne kerüljön publikálásra; 1= azonnal publikálásra kerüljön; 2= halasztottan kerüljön publikálásra
33	Post-trade referral reason	All	Nem	Amennyiben a Trade Publication indicator mezőbe a "2"-es érték került megadásra, akkor ebben a mezőben meg kell adni a halasztott közzététel okát: "LRGS" - szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügyletek esetében; "ILQD" - likvid piaccal nem rendelkező eszközök esetében "SIZE" - pénzügyi eszközre jellemző nagyságrendet meghaladó ügyletek esetében Validációs szabály szükséges: Ha a Trade publication indicator mező értéke "2", ez a mező töltendő
34	Regulatory Deferral Type	Non-equities	Nem	A helyi hatóságok egyedi elbírálása esetében adható halasztások jelzésre szolgáló flag megadása.
35	Free type field	All	Nem	
36	Free type field	All	Nem	
37	Free type field	All	Nem	
38	Free type field	All	Nem	
39	Free type field	All	Nem	