

Ügyfél-tájékoztató

A nyílt végű befektetési jegyek elszámolása BaNCS-ben és áttekintés WARP funkciók változásairól

2016. április 13.

Tisztelt Ügyfeleink!

Jelen tájékoztatónk keretében szeretnénk információt nyújtani Önöknek a KELER új számlavezető rendszerének, a BaNCS élesítésével együtt életbe lépő tervezett változásokról, amelyek a nyílt végű befektetési jegyek folyamatos forgalmazása kapcsán érintik a kibocsátási és elszámolási folyamatot, valamint bemutatjuk a BaNCS-szel együtt élesedő új WARP verzió funkcionális változásait.

1.1. Új számlatípusok

Bevezetésre kerülnek a **központi értékpapír nyilvántartási számlák**. Ezeket a számlákat az egyes értékpapír kibocsátói, azaz a **befektetési alapok nevében** nyitja meg a KELER, és tükörszámlaként, összesítve kerül ezeken kimutatásra egy-egy értékpapír sorozat teljes kibocsátott mennyisége.

A kibocsátási folyamat fontos elemei továbbá a **kibocsátói nyilvántartási számlák**, amelyeket az egyes **Alapkezelők nevében** nyit a KELER. Ezek a számlák korlátozott rendeltetésű, technikai célú számlák.

A befektetési jegyek (napi) rábocsátása és törlése során egyidejűleg jóváíródnak és terhelődnek a kibocsátói nyilvántartási számlákon az értékpapírok, miközben a központi értékpapír nyilvántartási számla és a Forgalmazó számlája között megtörténik a rábocsátás vagy törlés.

A két új számlatípust a KELER automatikusan, ügyfeleink külön rendelkezése nélkül megnyitja és hozzárendeli az érintett instrumentumokhoz.

E számlatípusok és új nyilvántartási mód bevezetése miatt megszűnik a jelenleg is alkalmazott dedikált kibocsátási és törlési számlaszámok kötelező használata, valamint e számlákhoz kapcsolódó értékpapír-transzferek alkalmazása. (Jelenleg érintett alszámlák: XXXX/606060, XXXX/676767, XXXX/787878). A BaNCS rendszerben valamennyi normál értékpapírszámlára és értékpapírszámláról történhet a befektetési jegyek rábocsátása és törlése.

Az egyes nyílt végű befektetési jegyekre vonatkozóan továbbra is az Elszámoló fél jogosult elszámolási tranzakciókat benyújtani. (Illetve nevében a KELER, amennyiben WARP-on keresztül kezdeményezett forgalmazási instrukció teljesítéséről van szó).

Az Elszámoló fél ISIN-hez rendelése az Alapkezelő írásos meghatalmazása alapján történik.

1.2. Nyílt végű befektetési jegyek napi rábocsátása (keletkeztetése) és törlése esetén alkalmazott általános könyvelési lépések bemutatása (BaNCS)

1.2.1. Napi rábocsátás (keletkeztetés):

Elszámolási tranzakció típusa: „SUBS”

Free of payment (FOP)

1.	(-) Központi értékpapír nyilvántartási számla [KELER\Befektetési alap]	(+) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]
2.	(-) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]	(+) WARP instrukcióban megjelölt számla [Forgalmazó]

Delivery versus payment (DVP)

Értékpapír könyvelések:

1.	(-) Központi értékpapír nyilvántartási számla [KELER\Befektetési alap]	(+) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]
2. *	(-) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]	(+) Forgalomba hozatali alapértelmezett számla [Elszámoló fél]
3. *	(-) Forgalomba hozatali alapértelmezett számla [Elszámoló fél]	(+) WARP instrukcióban megjelölt számla [Forgalmazó]

* Amennyiben a Forgalmazó megegyezik az Elszámoló féllel, a forgalmazói instrukcióban megjelölt számlán történik a jóváírás, a 3. pontban szereplő további könyvelési lépés kihagyásával

Pénzügyi kiegyenlítés:

(előfeltétele az értékpapír rábocsátásának)

1.	(-) WARP instrukcióban megjelölt számla [Forgalmazó]	(+) Elszámoló fél DVP pénzszámla (Értékpapír törzsadat) [Elszámoló fél]
----	---	--

1.2.2. Törlés:

Elszámolási tranzakció típusa: „**REDM**”

Free of payment (FOP)

1.	(-) WARP instrukcióban megjelölt számla [Forgalmazó]	(+) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]
2.	(-) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]	(+) Központi értékpapír nyilvántartási számla [KELER\Befektetési alap]

Delivery versus payment (DVP)

Értékpapír könyvelések:

1. *	(-) WARP instrukcióban megjelölt számla [Forgalmazó]	(+) Visszaváltási alapértelmezett számla [Elszámoló fél]
2. *	(-) Visszaváltási alapértelmezett számla [Elszámoló fél]	(+) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]
3.	(-) Kibocsátói nyilvántartási számla [Alapkezelő]	(+) Központi értékpapír nyilvántartási számla [KELER\Befektetési alap]

* Amennyiben a Forgalmazó megegyezik az Elszámoló féllel, az értékpapírok terhelése közvetlenül a forgalmazói instrukcióban megjelölt számláról történik, az 1. pontban leírt könyvelési lépés kihagyásával

Pénzügyi kiegyenlítés:

(előfeltétele az értékpapír törlésének)

1.	(-) Elszámoló fél DVP pénzszámla (Értékpapír törzsadat) [Elszámoló fél]	(+) WARP instrukcióban megjelölt számla [Forgalmazó]
----	--	---

1.3. Általános megjegyzések az elszámolási tranzakciók feldolgozása kapcsán

- Tranzakciókban érintett számlaszámok

Felhívjuk Tisztelt Ügyfeleink figyelmét, hogy a SUBS és REDM tranzakciókban eladóként és vevőként minden esetben az Elszámoló fél, illetve a Forgalmazó számlái kerülnek feltüntetésre, függetlenül attól, hogy a tényleges számlaműveletek során egyéb számlák is érintettek (több lépésből álló könyvelési sorozat), valamint egyes esetekben az Elszámoló fél számlája nem kerül ténylegesen terhelésre vagy jóváírásra. Így pl. FOP rábocsátás (SUBS) esetén eladóként ugyan az Elszámoló fél szerepel, azonban a terhelés már az alapkezelői kibocsátói nyilvántartási számlán történik, illetve törlés (REDM) esetén a Forgalmazó számlájának terhelése mellett szintén az alapkezelői kibocsátói számlán történik a jóváírás. Kérjük, hogy a tranzakciók és visszaigazolások rekonziliációja során ezt vegyék figyelembe.

- Egyoldalú tranzakció-benyújtás

Mind a SUBS, mind a REDM tranzakció típusok esetén egyoldalassá válik a megbízások benyújtása, azaz DVP ügylet esetén is kizárólag az Elszámoló fél nevében kerül feladásra a párosított megbízás WARP-ból a BaNCS felé. * (Megszűnik a jelen gyakorlat szerinti külön eladó, és külön vevő oldali DVP tranzakciók generálása és párosítása.)

- **Összekapcsolt egyedi tranzakciók**

A párosított tranzakciók feldolgozása során a BaNCS minden ügyletet felbont egyedi, eladói és vevői tranzakciókra, valamint DVP esetén külön kezeli az ügylet értékpapír és pénz oldali lábait is. Az egyes tranzakciók külön KELER referenciával rendelkeznek, de ezek a feldolgozás során minden esetben össze vannak kapcsolva, egymástól elválaszthatatlanok.

- **Az elszámolási tranzakciók ellenőrzése (státuszok, kivonatok)**

A következő lehetőségek állnak Ügyfeleink rendelkezésére:

- WARP elszámolási tranzakció áttekintő: Elszámoló fél által láthatók a részletes információk
- Értékpapírszámla kivonatok: Elszámoló fél és Forgalmazó részére (KID: EP02, SWIFT: MT536)
- Tranzakció státuszértesítők: Elszámoló fél és Forgalmazó részére (KID Közlemények: sese.024, SWIFT: MT548)
- WARP instrukció kezelés képernyőn, közvetve: minden érintett WARP ügyfél részére (Az egyes forgalmazási instrukciók WARP állapota a kapcsolódó, Elszámoló fél oldali elszámolási tranzakció státuszán alapul, továbbá a képernyőn látható CS/ DS / DVS mezőkben is feltüntetésre kerül a BaNCS által visszaküldött státuszkód.)

* Megjegyzés: A WARP-on kívül, formanyomtatványon kezdeményezett tranzakciókra külön szabályok érvényesek.

2. Legfontosabb funkcionális és felületi változások WARP-ban

A megújult WARP alkalmazás igazodik a BaNCS rendszer jellemzőihez, így mind a törzsadatok, mind az elszámolási tranzakciók kezelése terén jelentős átalakításra került sor. A legfontosabb, Ügyfeleink által tapasztalható változások a következők:

2.1. Törzsadat-kezelés és beállítások:

- **Értékpapírszámlák:**

- Az értékpapírszámlák egységesen új formátumot kapnak, amelyek 11 karakter hosszúságúak.
- Szabadon kijelölhetők az Elszámoló fél forgalomba hozatali és visszaváltási alapértelmezett számlái. (Ezek a DVP tranzakciók könyvelése szempontjából lényegesek, ld. 1.2.)

- **Pénzszámlák:**

A KELER-nél vezetett pénzszámlák ún. multidevizás számlaként funkcionálnak a BaNCS élesztést követően. Ez lehetővé teszi, hogy devizanemtől függetlenül ugyanazt a pénzszámlát használják ügyfeleink az ügyletek kiegyenlítéséhez. Ezzel összefüggésben a WARP-ban a KELER típusú pénzszámla rekordok - IBAN szerint - összevonásra kerülnek, így egy IBAN-nal rendelkező számlaszám csak egyszer jelenik meg a pénzszámlák között, üres devizakóddal.

- **Értékpapírok:**

Új kibocsátású értékpapírok esetében, az instrumentum adatai már az első keletkeztetést megelőzően elérhetővé válnak a WARP-ban, így Alapkezelő ügyfeleink jóval korábban elvégezhetik a szükséges paraméterek beállítását.

- **Elszámolási beállítások:**

- Kivezetésre kerül a '*Keletkeztetés módja (FOP)*' beállítási opció, mivel ezentúl minden rábocsátás (keletkeztetés) a forgalmazói instrukcióban jelölt számlára történik.
- Az '*Elszámolás automatikus indítása*' oszlopban átnevezésre kerültek egyes opciók (Aktív, Inaktív)

2.2. Elszámolási tranzakciók kezelése

- **Megszűnő FOP transzferek**

Igazodva a BaNCS tranzakció-kezelési folyamataihoz, jelentősen egyszerűsödik a nyílt végű befektetési jegyek elszámolása, elsősorban a FOP ügyletek kapcsán.

Mivel a forgalmazási instrukciók tetszőleges forgalmazói értékpapírszámlára benyújthatók, ezért kivezetésre kerülnek a FOP értékpapír-transzferek.

Ez alapján egy WARP instrukcióhoz mindössze egy WARP elszámolási tranzakció tartozik. (rábocsátás: „SUBS” vagy törlés: „REDM”), egyszerűsítve ezzel a WARP-on belüli státuszkezelést is.

- **Státuskódok változása**

Az elszámolási tranzakciók áttekintő képernyőn, illetve az exportálható listában új, a BaNCS által küldött ISO20022 szabvány szerinti státusz- és reason kódok kerülnek feltüntetésre. Az elszámolási tranzakciók áttekintő képernyőn - az egyoldalú tranzakció-beküldés miatt - a tranzakciókra vonatkozó információk kizárólag az Elszámoló fél számára érhetők el.

- **Múltbeli értéknapos tranzakciók beküldése**

Lehetővé válik az eredeti értékpapír elszámolási dátumot követően is a tranzakciók beküldése a BaNCS rendszer felé, visszautasítás nélkül. A BaNCS az ilyen megbízásokat a beérkezést követően, az első lehetséges elszámolási napon dolgozza fel.

- **Elszámolási tranzakciók törlése**

Amennyiben valamilyen oknál fogva (pl. értékpapír- vagy pénz oldali fedezetlenség miatt) szükségessé válik egy, már BaNCS felé beküldött, de még nem teljesült elszámolási tranzakció törlése, akkor azt továbbra is WARP-on kívül, formanyomtatvány útján kérheti az Elszámoló fél.

2.3. Egyéb

- Trailer fee egyenleg-lekérdezés: a szolgáltatás aktiválásának hónapjában a hónap első napjáig visszamenőlegesen elérhetők lesznek az adott értékpapír KELER számlákon nyilvántartott egyenlegei
- Instrukció import formátum változása (11 karakteres számlaszám miatt)
- Instrukció export formátum változása (számlaszám formátum, illetve bővített adattartalom miatt)

Üdvözlettel:

KELER Központi Értéktár Zrt.