

KELER – 15/2018. számú Értéktári leirat

A MiFID II./MiFIR jogszabályokban előírt
illetékes hatóságnak küldendő (ARM) és
transzparencia (APA) jelentésekre vonatkozó
KELER szolgáltatás részletes szabályairól

Hatálybalépés dátuma: 2018. szeptember 13.

A jelen Értéktári Leirat részletezi a KELER Zrt. (KELER) Általános Üzletszabályzatának 8.8. és 8.9. pontja szerinti, azaz a 600/2014/EU rendelet (MiFIR) 14. és 18. valamint 20-21. cikke szerinti közzétételi kötelezettség teljesítésére, emellett a MiFIR 26. cikke szerinti ügyletjelentési kötelezettség teljesítésére vonatkozó szolgáltatások egyes részletszabályait.

ARM szerepkörre vonatkozó szabályok – ARM jelentések folyamata

A KELER az ügyfelei számára szolgáltatásként nyújtja a MiFIR 26. cikke szerinti jelentés (ARM jelentés) MNB felé történő továbbítását.

A folyamat során biztosítja, hogy a szükséges jelentések akár automatikusan (web-service kapcsolaton keresztül) akár kézi feltöltéssel manuálisan (a KELER Trade Reporting rendszerén keresztül) a KELER felé megküldésre kerüljenek. A KELER, a felé megküldött jelentések kapcsán mindig elvégzi a jelentésekben szereplő tranzakciók első szintű formai és logikai ellenőrzését is.

A formai ellenőrzés során bizonyos tartalmi ellenőrzéseket is elvégzünk, ilyen például, a jelentésben szereplő LEI kódok esetében nemcsak azok hossza, hanem azok konkrét értéke is ellenőrzésre kerül, azaz csak olyan LEI kód szerepelhet a jelentésben, ami valóban kiadásra is került. A KELER felé az ARM jelentések megküldésére XML vagy XLSX formátumban van lehetőség. A KELER a felé megküldött jelentéseket minden esetben az ISO szabvány által elvárt XML formátumban küldi tovább az MNB felé.

A KELER által megszerzett ARM engedély Európa összes országában érvényes, így lehetőség van, hogy a tranzakciós jelentések nem csak az MNB, hanem egy másik országban működő hatóság az illetékes, akkor az adott ország hatósága felé is megküldésre kerüljön. Azonban ebben az esetben fontos kiemelni, hogy az engedély megszerzésén túl ennek feltétele az is, hogy az adott hatósággal a KELER kiépítse a megfelelő kommunikációs kapcsolatot is, aminek azért mind idő mind fejlesztési oldala is van. Ezért minden esetben külön vizsgálatot igényel, hogyha a tranzakciós jelentések megküldése nem az MNB felé történik.

A KELER felé megküldött jelentések státusza folyamatosan elérhető a KELER Trade Reporting rendszerében, azaz nyomon követhető, hogy a jelentések befogadásra kerültek-e az MNB részéről. Hibás jelentések esetében pedig a visszajelzések tartalmazzák a hiba pontos okát.

A KELER felé megküldött ARM jelentésben több ügylet is bejelentésre kerülhet. A KELER minden esetben ellenőrzi a jelentéseket és csak a formailag és bizonyos tartalmi szempontok alapján, hogy biztosítsa, hogy megfelelő jelentések kerülnek az MNB felé továbbításra, a hibás jelentések visszautasításra kerülnek. Ezt követően a hibák javítása után már csak a javított állományokat kell megint a KELER felé megküldeni nem pedig a korábbi teljes csomagot, hiszen a korábban márt befogadott jelentések duplikációra való hivatkozással elutasításra fognak kerülni egy újbóli beküldés során.

Jelentések javításának, módosításának folyamata

Az ARM jelentések esetében két üzenettípus küldhető be: új jelentés (New) vagy törlés (Cancel).

Egy korábban beküldött jelentés módosítására is van lehetőség, azonban erre sincs külön üzenettípus, hanem a korábbi ügyletre küldött törlő üzenet után van lehetőség egy új jelentés keretében a szükséges módosítás beadására.

Fontos, hogy a módosítási szándékkal beküldött új jelentés esetében az eredetileg megadott egyedi ügyletazonosító (transaction reference number) ismét felhasználásra kerülhet.

Törlő üzenet esetében nem kell az egész jelentést újraküldeni, hanem elegendő egy rövid üzentben mindösszesen az alábbi adatokat megadni:

- Egyedi ügyletazonosítót (Transaction reference number);
- A végrehajtó (executing) jogi személy azonosítóját (LEI kód) és;
- Beküldő (submitting) jogi személy azonosítóját (LEI kód) megadni.

Az egyedi ügyletazonosító és a végrehajtó jogi személy azonosítója egyértelműen azonosítja az ügyletet, ami törlése kerül.

Törölni nemcsak már az illetékes hatóság által befogadott jelentéseket lehet, hanem a még függő (pending) státuszba lévőket is, így amennyiben például az ISIN kód ellenőrzés kapcsán egy ügylet már több napja a fenti státuszba van, törlés akkor is küldhető az ügyletre, ami így azonnal végre is fog hajtódni és az ügylet státusza várakozóról törölt státuszra fog változni.

Vizont az illetékes hatóság által elutasított jelentésre nem küldhető be törlő üzenet.

Módosítás esetében, ha az adott ügyletre nem volt korábban törlő üzenet feltöltve, akkor a módosítási szándékkal beküldött új jelentés elutasításra fog kerülni (duplikációra történő hivatkozással, hiszen a jelentésben megadott egyedi ügyletazonosító már benne lesz a rendszerbe).

Egy több jelentést tartalmazó üzeneten belül egyaránt szerepelhet új és törlő üzenet is. Azonban a sikeres feldolgozás érdekében javasolt, hogy az egy adott ügyletre vonatkozó új és törlő üzenet ne egy állományban kerüljenek beküldésre. Ebben az esetben kérjük, külön üzenetbe kerüljenek ezek bejelentve.

ISIN kód használata

Az ARM jelentések esetében fontos termékazonosító az ISIN kód, ami minden esetben ellenőrzésre kerül az illetékes hatóság által a tranzakciós jelentés befogadást megelőzően.

A jelentésekben szereplő ISIN kódok az ESMA által karbantartott, úgynevezett Financial Instruments Reference Data System (FIRDS), adatbázisban szereplő adatokkal kerülnek összevetésre. A FIRDS rendszer naponta frissül a kereskedési helyszínek és a rendszeres internalizálók által megküldött adatokkal (új termék ISIN kódjaival).

Amennyiben egy jelentésben megadott ISIN kód nem szerepel a FIRDS rendszerben, akkor nem kerül egyből elutasításra, hanem a következő 7 napban folyamatosan kerül a FIRDS rendszerből lekérdezésre. Amennyiben ebben a hét napban a bejelentésben megadott ISIN kód bekerül a FIRDS rendszerbe, akkor a jelentés befogadásra kerül, amennyiben azonban erre 7 nap alatt nem kerül sor, akkor a jelentés elutasításra fog kerülni.

A KELER ARM szolgáltatás során maga is összeveti a felé feltöltött jelentésekben szereplő ISIN kódot a FIRDS rendszerben szerepelőkkel, azonban ha ezt nem találja meg, akkor sem kerül a jelentés a KELER részéről elutasításra, azonban külön megjelenítésre kerül a felhasználók számára, hogy az adott napon hány olyan jelentés volt, amelyek ISIN kódja a jelentés feltöltésénél nem voltak benne a FIRDS adatbázisban.

A felhasználók így folyamatosan nyomon követhetik jelentéseik státuszát, valamint azt, hogy hány nap van még hátra az említett 7 napból.

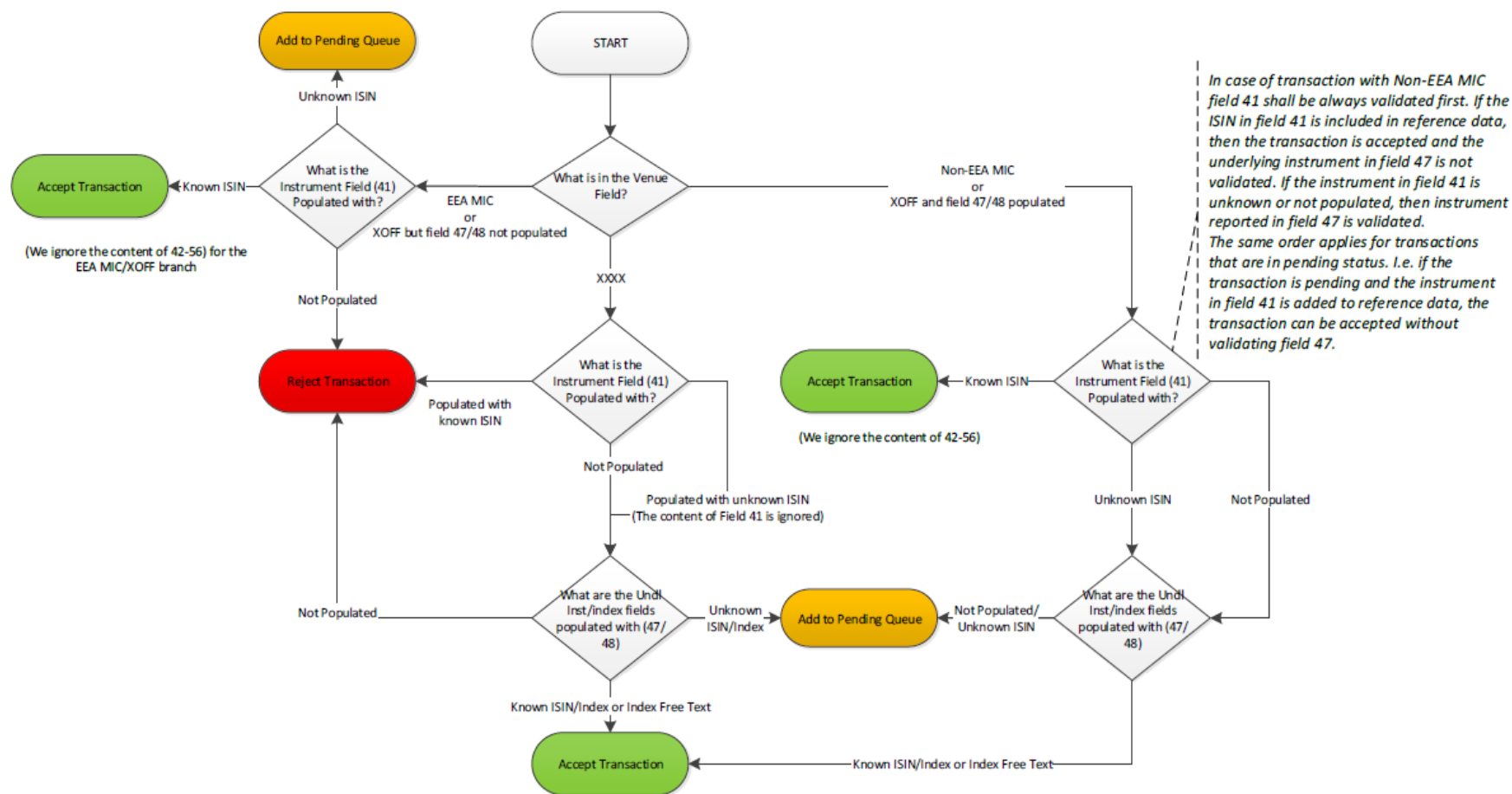
Az ISIN kódok használata során az alábbi szabályrendszer került az ESMA részéről kialakításra:

- a) Amikor egy tranzakció egy Uniós kereskedési helyszínen, SI-n vagy tőzsdén kívül (XOFF*) kerül végrehajtásra, akkor a termék ISIN kódja (field 41) kerül ellenőrzésre a FIRDS adatbázis összevetésével. Ebben az esetben magával a termékkel kereskednek egy kereskedési helyszínen, de lehet, hogy az ügylet megkötésre nem ott került sor. (XOFF);
- b) Amikor egy tranzakció egy Unión kívüli szervezett kereskedési helyszínen kerül végrehajtásra, akkor mind a termék mind az alaptermék ISIN kódja (fields 41, 47) ellenőrzésre kerül - az egyiknek szerepelnie kell a FIRDS adatbázisában;
- c) OTC tranzakciók esetében (Venue mező értéke XXXX*) akkor az alaptermék ISIN kódja (field 47) kerül összevetésre a FIRDS adatbázisával;
- d) OTC ügyletek vagy Unión kívüli szabályozott piaci helyszínen végzett tranzakciók esetében (Venue mező értéke XXXX) ha az alaptermék (field 47) egy index, akkor a jelentésben szereplő ISIN kód nem kerül ellenőrzésre.

Venue mező értéke, ha nem egy MIC kód, akkor:

- *XOFF ha a termék bevezetésre került egy szabályozott piacra, de az ügyletkötésre azon kívül kerül sor,
- *XXXX ha a termék nem került bevezetésre szabályozott piacra (nincs ISIN kódja), de az alaptermékül szolgáló termékkel kereskednek egy szabályozott piacon.)

A fentieket a következő ESMA által kiadott ábra is tartalmazza:



KELER Tranzakciós jelentések beküldése

A KELER Trade Reporting rendszere fogadja a KELER felé megküldött tranzakciós jelentéseket is. A KELER TR rendszere az ARM jelentések kapcsán munkanapokon 8:30 és 18:00 között fogadja a jelentéseket.

Ez időszak alatt van lehetőség a jelentések manuális vagy web service-en keresztül, KELER felé történő továbbítására, illetve a feltöltött, megküldött jelentésekre vonatkozó visszaigazolások is ezen időszakon belül elérhetők, a kapcsolódó beérkezési-visszaigazolási határidőknek megfelelően.

A fent meghatározott üzemidőn kívül a KELER Trade Reporting rendszere nem lesz elérhető, azaz újabb jelentések feltöltésére nem lesz lehetőség, illetve, a már korábban megküldött jelentésekhez kapcsolódó monitoring funkciók sem lesznek megtekinthetőek.

A normál üzemszerű működés esetén (a jelentési folyamatban érintett szolgáltatások elérhetőek, feldolgozási és kommunikációs folyamatok megfelelően futnak) a KELER Trade Reporting rendszere felé feladott jelentésekhez kapcsolódóan a KELER által előállított formai-logikai ellenőrzés eredményéről szóló visszaigazolásokat és az illetékes hatóságtól kapott visszaigazolásokat legkésőbb fél órán belül megküldi a jelentést beküldő partner felé.

A jelentések manuális feltöltése esetén a visszaigazolások a Trade Reporting rendszer webes felületén érhetőek el.

A nem normál üzemszerű működés esetén (technikai és kommunikációs problémák fennállása esetén) a KELER biztosítja, hogy az adott napon a probléma megjelenését követően legkésőbb 4 órán belül helyreállítja a normál üzemszerű működést.

A nem normál üzemszerű működés esetén, a KELER Trade Reporting rendszerének adott napi üzemidején belül várhatóan nem megoldható problémák esetén a KELER által kidolgozott üzletmenet-folytonossági folyamat kerül alkalmazásra.

A KELER Trade Reporting rendszerének hibája esetén (legyen szó technikai vagy kommunikációs hibáról), melynek okán az ügyfelek nem tudnak jelentéseket beküldeni a rendszeren keresztül, a KELER Service Desk osztálya haladéktalanul értesítést küld az érintett ügyfelek felé. A megküldött értesítés tartalmazza a hiba okának leírását és a várható javítási időt. Amennyiben a hiba előreláthatólag nem javítható a KELER Trade Reporting rendszerének adott napi üzemidején belül, akkor a kapcsolódó BCP folyamat részeként a KELER Service Desk által megküldött értesítés tartalmazni fogja azt a leírást is, hogy mely módon van lehetőség a jelentések KELER felé történő továbbítására. Az elsődleges csatorna ilyen esetekben az Alternatív Jelentéstovábbítási Megoldás című fejezetben leírt e-mail-es beküldés, amihez a kapcsolódó e-mail cím a már említett tájékoztatóban megküldésre kerül a Service Desk által. A KELER a BCP folyamat során felé megküldött e-maileket haladéktalanul feldolgozza és küldi tovább az illetékes hatóság felé.

Amennyiben a KELER és az illetékes hatóság közötti kommunikációba lép fel hiba, akkor az ügyfelek a normál működés szerint tudják a jelentéseket továbbítani a KELER felé, melyek a KELER és az illetékes hatóság között kidolgozott BCP folyamat szerint kerülnek lekezelésre.

A KELER nem vállal felelősséget az illetékes hatóságnál fellépő hibák okozta késedelmek miatt.

Jelentésállományok formai követelményei

A jelentésállományok formai követelményeit a KELER által meghatározott specifikációk tartalmazzák, melyek kérésre az ügyfelek felé megküldésre kerülnek.

Alternatív jelentéstovábbítási megoldás

Mivel az MNB részéről nem kerültek publikálásra a tranzakciós jelentések automatikus továbbításához szükséges beállítások, ezért 2018. január 3-tól határozatlan ideig a KELER a tranzakciós jelentések MNB felé történő továbbítását csak manuálisan, az MNB erre a célra kialakított KAP rendszerébe történő közvetlen feltöltéssel tudja biztosítani.

A teljesen automatikus üzenetkezelés kialakításáig, valamint azt követően, amennyiben a KELER vagy az illetékes hatóság oldalán IT hiba ezt szükségessé teszi, az ügyfeleink az alábbi folyamat szerint tudják a tranzakciós jelentéseiket a KELER felé megküldeni, illetve az azokra vonatkozó visszaigazolásokat megkapni:

- Az ügyfeleknek a tranzakciós jelentéseiket e-mailen a tradereporting@keler.hu címre kell megküldeniük;
- A megküldött jelentéseket tömörítve és titkosítva kell a fent említett címre megküldeni;
- A titkosításhoz használt jelszó minden ügyféllel egyedileg kerül egyeztetésre;
- A KELER minden, az adott nap 16:00-ig megkapott jelentést továbbítja az MNB felé;
- A KELER nem köteles az adott nap 16:00 után megküldött jelentések még aznap az MNB felé feltöltésére;
- A fenti határidők egyaránt vonatkoznak az új vagy törlő/módosított üzenetekre;
- A KELER minden feltöltésről e-mailben visszaigazolást küld az ügyfélnek;
- Annak érdekében, hogy a visszaigazolásokat ne csak a jelentést KELER felé megküldő felhasználó kapja meg, lehetőség van csoportos e-mail cím megadására is;
- A KELER a feltöltést követően MNB-től kapott küldemény értesítőt is megküldi az ügyfelek számára (ebben az esetben is igaz, hogy az adott nap 16:00-ig megkapott visszaigazolásokat még aznap továbbítja, az ezután érkező visszaigazolások legkésőbb másnap reggel 10:00-ig kerülnek visszaküldésre);
- Minden jelentésfeltöltésről a KELER két értesítést küld, egyikben az kerül visszaigazolásra, hogy az MNB számára beérkezett az állomány (K-számot tartalmazó küldemény értesítő), míg a másikban a jelentés státusza kerül visszaigazolásra (értesítés adatszolgáltatás státuszáról). A jelentési kötelezettség teljesítése csak feldolgozott státuszú jelentés esetén következik be.
- Hibás jelentés esetén a KELER megküldi az MNB-től kapott teljes hibalistát, ami alapján ügyfeleink feladata a hibák kijavítása és a javított jelentés újbóli feltöltése;
- Kérjük, a KELER felé megküldött állományok elnevezése az alábbi szabály szerint kerüljön kialakításra:

„registered number_DATTRA_reporting period.xml”

A törzsszám (registered number) a befektetési vállalkozás törzsszámát jelenti (adószám első nyolc karaktere), akinek a nevében a KELER jelent. A reporting period pedig az adott nap dátuma, amikor a jelentés a KELER felé megküldésre kerül (pl.: 20180104)

A fentebb írtak alapján a tranzakciós jelentések induláskor nem a KELER Trade Reporting rendszerébe kerülnek feltöltésre, ezért a KELER nem is tudja a felé megküldött jelentések formai vagy tartalmi előszűrését elvégezni. A felé megküldött jelentések módosítás nélkül kerülnek az MNB KAP rendszerébe feltöltésre.

A KELER tervei szerint január közepétől a tranzakciós jelentések már a KELER Trade Reporting rendszerén keresztül küldhetőek meg a KELER felé, mely esetben már megvalósul a jelentések formai és tartalmi előszűrése. A szükséges jogosultságok beállításához a KELER ARM szolgáltatására vonatkozó szerződés mellékletében kell megadni a felhasználók adatait.

A KELER az átmeneti időszakban felé e-mailen megküldött azon jelentéseket, amik az MNB részéről befogadásra is kerültek a KELER Trade Reporting rendszerébe is bedolgozza, így a későbbiekben lehetőség lesz ezen jelentések javítására/törlésére is.

A jelen pontban leírt alternatív módszer az ARM formaszerződés 3.5. pontja szerinti alternatív módszernek számít.

APA szerepkörre vonatkozó szabályok – jelentések folyamata

A KELER mint APA szolgáltató a szolgáltatás keretében az alábbi kötelezettségek teljesítéséhez nyújt segítséget:

1. kereskedés előtti közzétételi kötelezettség teljesítése;
2. kereskedés utáni közzétételi kötelezettség teljesítése;

A kereskedés előtti közzététel során azon befektetési vállalkozások, akik rendszeres internalizálóknak (SI)¹ minősülnek, a szokásos kereskedési időben rendszeresen és folyamatosan közzé kell tenniük a kötelező érvényű jegyzéseiket. A KELER 10 percen belül publikálja az ellenőrzött jelentéseket. A KELER szolgáltatása a MiFIR 18. cikk (2) bekezdés szerinti közzétételi kötelezettségre nem terjed ki.

A kereskedés utáni közzététel, mely minden befektetési szolgáltatóra vonatkozik, esetében különbséget kell tennünk a részvény típusú („equity like”) és a nem-részvény („non-equity like”) típusú pénzügyi eszközre vonatkozó ügyletek között. Az első esetben az ügyletkötést követő 1 percen belül meg kell történnie az ügyletadatok nyilvánosságra hozatalának, míg ez az időhatár a másik termékkör esetében 15 perc. Az egyes terméktípusok esetében a megadandó mezők között is számíthatunk eltérésre.

A közzétételi kötelezettség kapcsán publikálandó adatok

A kapcsolódó szabályozástechnikai standardok (a Bizottság 2017/583/EU és 2017/587/EU számú felhatalmazáson alapuló rendeletei) foglalják össze az APA-knak továbbítandó és általuk nyilvánosságra hozandó adatokat. A publikálandó adattartalmat illetően különbséget kell tennünk a kereskedés előtti jelentések, valamint a kereskedés utáni jelentések, azon belül is a részvény típusú és a nem-részvény típusú termékek között, viszont a KELER egy jelentési sablont alakított ki, hogy Ügyfeleink minden jelentés, termékkör adatainak nyilvánosságra hozatalához azonos formátumú sablont tudjanak használni. A KELER rendszere ellenőrzi az egyes jelentésekben, hogy az adott termék kapcsán elvárt mezőket töltötték-e ki. Amennyiben nem, úgy a KELER a jegyzés vagy az ügylet jelentését visszautasítja, valamint hibaüzenetet küld a visszautasítás pontos okáról.

A kereskedés utáni nyilvánosságra-hozatalra vonatkozóan a KELER jelentési sablonja és a részletes üzenetleírások kérése az ügyfelek felé megküldésre kerülnek.

¹ A MiFID II. definíciója alapján rendszeres internalizálóknak minősül az a befektetési vállalkozás, amely az ügyfélmegbízások végrehajtásakor saját számlára kereskedik szervezeten, rendszeres gyakorisággal és jelentős nagyságrendben, valamely szabályozott piacon, multilaterális kereskedési rendszerben vagy szervezett kereskedési rendszeren kívül, illetve multilaterális rendszer működtetése nélkül.

Ahhoz, hogy egy befektetési vállalkozás rendszeres internalizálóknak minősüljön, mindkét előre meghatározott küszöbértéket - azaz egyrészt a gyakoriság és rendszeresség küszöbértékét, másrészt a jelentős nagyságrendre vonatkozó küszöbértéket is - túl kell lépnie, vagy úgy kell döntenie, hogy rendszeres internalizálóknak minősíteti magát.

A jelentések kitöltése

Az „action type” mező használata – Státuszkezelés

Minden elsőnek beküldött jelentésben az „Action type” értéke csak N lehet.

A beküldött jelentésekre a KELER egyrészt formai, másrészt bizonyos mezők kapcsán logikai, tartalmi ellenőrzést is folytat. Csak az ellenőrzések folyamán megfelelően nyilvánított jelentéseket fogadja be (és publikálja) a KELER rendszere.

A befogadás után a rendszer publikálja a jelentést és a publikálást követően az ügyfelek számára elérhetővé teszi a státuszok lekérdezését (web-service-en és a TR rendszer felületén keresztül is). A KELER által küldött státuszüzenetek minden esetben tartalmazni fogják az ügyfél által megadott összes adatot, kiegészítve a KELER által generált TIC (KELER által adott egyedi azonosító) kóddal és a publikálás időpontjával.

A fenti státusz - azaz amikor a befektetési szolgáltató az APA-tól megkapja a visszaigazolást az általa beküldött minden adattal, az APA által generált TIC azonosítóval és a publikálás idejével együtt - bekövetkeztekor teljesül a befektetési szolgáltató közzétételi kötelezettsége, a kereskedés utáni közzététel teljesítésének. Amennyiben a jelentést a rendszer az ellenőrzés során elutasítja, úgy a TIC kódot sem generálja a rendszer, válaszul pedig a jelentést tevő egy hibaüzenet kap. Hibás jelentés esetén a jelentésben található összes hibát visszaigazoljuk.

Publikált jelentések módosítása, törlése

Csak egy, már sikeresen publikált jelentés *(az ügyfél megkapta az erre vonatkozó visszaigazolót, ami tartalmazza a TIC kódot és a publikálás idejét is)* esetében van lehetőség annak módosítására vagy törlésére.

A törölni kívánt üzenet esetében küldeni kell egy új üzenetet, aminek minden korábban már megadott mezőt, valamint az idő közben az APA általa visszaigazolásban megküldött publikálás idejét és a TIC-et is tartalmaznia kell. Ebben az esetben az „Action type” mező értéke „N” helyett „C” lesz. A KELER a törölő üzenetet is publikálni fogja, a publikálás során a FLAG mezőben a „CANC” értéket megadva.

Törölő („C”) üzenet esetén új TIC-et nem generálunk, a korábbi jelentés során kapott TIC kódot kell feltüntetni.

Egy korábban lejelentett és publikált jegyzés vagy ügylet módosítására is van lehetőség („M” üzenet). Ebben az esetben is először egy törölő („C”) üzenetet kell a jelentő félnek küldenie.

Az APA ezt a fentiekben bemutatottak szerint publikálja, majd ezt követően van lehetőség a módosító üzenet beküldésére, aminek szintén minden korábban megadott adatot tartalmaznia kell, a kívánt javításokkal együtt. Ebben az esetben előfordulhat olyan is, hogy korábban egy mezőben volt érték, de a javítás miatt most az a mező üresen maradt (ez az ellenőrzések során nem fog hibaként előjönni, amennyiben egyébként megfelel az üzleti logikai szabályoknak). A módosító üzenet publikálása során a „FLAG” mezőben az „AMND” értéket adja meg a KELER.

Fontos, hogy alapesetben a módosítás miatt beküldött új üzenetek („C” majd „M”) esetében új TIC kódot nem képezünk, azaz az eredetileg adott TIC azonosítót kell mind a „C” mind az „M” üzenetben szerepeltetnie a beküldőnek.

Ez alól a szabály alól egy eset jelent kivételt: amennyiben az „Instrumentum identifier” mező értéke) változik a módosítás során. Ebben az esetben a korábbi jelentés törölendő egy „C” üzenettel, majd ennek publikálása után egy új „N” típusú üzenet beküldése szükséges. A TIC mezőt üresen kell hagynia a beküldőnek, - mint minden „N” üzenet esetében -, a KELER pedig új TIC kódot fog generálni a jelentéshez és a korábbi, javított jelentéstől független jelentésként fog szerepelni a rendszerben.

Lehetséges esetek:

	Esemény	Action type mezőben szereplő érték	Publikálás során a FLAG mezőben szereplő érték	KELER felé küldendő jelentésben a TIC kód szerepel?	Megjegyzés
1	Új jelentés beküldése	N	üres	Nem	
2	Korábban publikált jelentés törlése	C	CANC	Igen	Feltétel, hogy korábban már legyen egy publikált új jelentés - publikálásról akkor beszélünk, ha az ügyfél státusz üzenetben visszakapta a KELER-től a publikálás idejét, valamint a PUBLISHED státuszt.
3	Korábban publikált jelentés módosítása (Instrumentum ID mező nem változik)	M	AMND	Igen	Feltétel, hogy az adott ügyletre vonatkozóan (TIC kód alapján) legyen egy törlés üzenet - amelynek státusz üzenetében az ügyfél megkapta a CANCELLED státuszt.
4	Korábban publikált jelentés módosítása (Instrumentum ID mező változik)	N	üres	Nem	Amennyiben az Instrumentum ID változik, akkor az nem módosítás, hanem új ügyletnek számít: feltétel, hogy a javítandó jelentés először egy "C" üzenettel törlésre, és a törlés publikálásra kerüljön.

A kereskedés előtti jelentések elkülönítése

A kereskedés előtti jelentéseket a kereskedés utáni jelentésekkel megegyező módon kell beküldeni a KELER TR rendszeren keresztül. A kereskedés előtti jelentéseket a Counterparty ID mező értéke különbözteti meg a többi jelentéstől: ezen jelentések esetében a „PRE-TRADE” érték megadása szükséges ebben a mezőben.

Kereskedés utáni adatok időkorláton túli jelentése vs. halasztott jelentés

Az APA szolgáltatókkal szemben elvárás, hogy a beérkezett jelentéseket mielőbb publikálják. Jogszabályi előírás alapján részvény típusú instrumentumok esetén az ügyletkötést követő 1 perc áll az APA-k rendelkezésére az adatok nyilvánosságra hozatalára, nem részvény típusú ügyletek esetén ez az időkorlát 15 perc.

A KELER egyetlen jelentést sem fog időkorlát túllépés miatt elutasítani vagy bármilyen negatív jelzéssel („FLAG”-gel) ellátni; minden szükséges esetben publikáljuk ezeket a jelentéseket is.

Amennyiben egy piaci szereplőnél rendszeresen, akár napi szinten többször is előfordul, hogy nem tartja be a jogszabályban előírt jelentéstételre vonatkozó időkeretet, a KELER mint APA, a vonatkozó jogszabályok rendelkezései alapján egyeztet az érintettel a késve történő jelentés megszüntetésének, vagy legalább mértéke csökkentésének szükségességéről és lehetőségéről.

A vonatkozó jogszabályok bizonyos esetekben lehetőséget biztosítanak a fent említett időkorlátot meghaladó publikálásra, amihez az illetékes felügyelet előzetes jóváhagyása szükséges (bővebb információt a jelen dokumentum „FLAG”-ek használatára vonatkozó fejezete tartalmaz). A KELER a kezdeti időszakban minden beérkezett jelentést nyilvánosságra hoz, anélkül, hogy vizsgálná, az adott ügylet kapcsán fennáll-e halasztott közzétételi lehetőség.

A KELER üzenetspecifikációjában a „Trade Publication indicator” mező ad lehetőséget az ügyfeleknek, hogy halasztott közzétételi szándékukat jelezzék, a jelentés KELER-hez történő beküldésének időpontjában.

Adatok APA által történő módosítása

A már publikált jelentések kapcsán jogszabályi elvárás, hogy azok tartalmát az ügyfelek kérésére az APA szolgáltatók is módosítani tudják. Ezért a jogosultsági rendszer úgy került kialakításra, hogy a KELER az ügyfelek kérésére (természetesen csak indokolt esetekben, amikor az ügyfélnek nem áll módjában ezt megtennie), az ő nevükben is tudja törölni/módosítani a beadott és már publikált jelentéseket.

Ez jelentené a BCP folyamat alapját is, amelynek keretében, ha a KELER TR rendszere és az Ügyfél között valamiért elakad a kommunikáció, akkor lenne lehetőség az ügyfél által e-mailen megküldött jelentések módosítására.

A jelentések beküldésének lehetőségei

A kereskedés előtti és utáni transzparencia jelentéseket kétféle módon lehet a KELER-nek továbbítani:

1. az elvárt XML vagy XLSX formában küldött jelentés manuális feltöltésével a KELER Trade Reporting rendszerébe;
2. a jelentés web-service szolgáltatáson keresztül automatikusan kerül feltöltésre.

Figyelembe véve a jelentések során elvárt publikálási határidőket (1 és 15 perc), a legjobb megoldás a jelentések web-service-en keresztül történő beküldése lenne, ami a KELER és az Ügyfél közötti automata kommunikációs megoldás kiépítését jelenti.

A KELER jogértelmezés alapján megfogalmazott saját elvárása, hogy minden jegyzést, ajánlattételt, kereskedés közzétételre kötelezett ügyletet külön jelentsen a jelentő fél. Ennek oka egyrészt a publikálásra rendelkezésre álló rövid határidő. Késést eredményez, ha az ügyfelek több, különböző időpontban adott ajánlatot vagy megkötött ügyletet szerepeltetnének egy jelentésben (kivételt képeznek az összevonásra érvényes szabályok). Továbbá, a KELER mint APA több ellenőrzést is le kell, hogy folytasson, mielőtt publikálná az adott jelentéseket, szintén a megadott időkereteken belül.

KELER TR rendszerében szereplő mezők

A fenti említett feltöltési megoldások esetén a jelentés státuszok, visszaigazolások, esetleges hibajelzések is elérhetőek lesznek a KELER Trade Reporting rendszerében.

Az APA a kereskedés előtti és utáni közzétételekre vonatkozó jelentések kezelése, a beküldött jelentésekkel kapcsolatos alapinformációk (feltöltés azonosító, beküldési csatorna, feltöltés ideje, feltöltő személye és a jelentés státusza) a „**Transaction monitoring**” menüpontban lesznek elérhetők.

A kereskedés előtti jelentések a Counterparty ID mezőben szereplő „PRE-TRADE” értékre való szűréssel jeleníthetők meg.

A „**Trade monitoring**” felületen a jelentések részletesebb adatait jelenítjük meg.

Alapadatok:

- Upload ID (KELER TR rendszerében megjelenő feltöltés azonosító - kvázi a feltöltött jelentés sorszáma);
- TIC azonosító;
- Eredeti jegyzés/ügylet azonosítója;
- Jegyzés / Ügyletkötés ideje;
- Publikálás ideje;
- ISIN azonosító;
- FLAG-ek;
- Státusz.

További választható adatok (az alapadatokon felül):

- Termék típusa (Product type mezőbe megadott értékek);
- Termék altípusa (derivatívák esetében);
- Price és mértékegység;
- Mennyiség és mértékegység;
- Counterparty ID;
- Teljes mennyiség.

A fenti szűrések eredményét MS Excel formátumban is le lehet majd tölteni.

Kereskedés utáni jelentésekkel kapcsolatos TR statisztikák

A fentiekén kívül a kereskedés utáni közzététel kapcsán egy, a főbb statisztikákat tartalmazó felület is kialakításra került. Itt megadható lesz egy időintervallum, melyre a lekérdezés irányul. Ezt követően az alábbi adatok kerülnek listázásra:

Beküldött jelentések száma: Az adott időszak alatt beadott és befogadott kereskedés utáni közzétételek összessége. Fontos megemlíteni, hogy a KELER TR rendszere logikai és tartalmi ellenőrzést is végez, azonban a formai ellenőrzés még a rendszerbe való beérkezés előtt lefut: így, ha egy beküldött jelentés formai hibát tartalmaz, akkor azt a KELER nem fogadja be, nem is jut el a TR rendszerig, ezért ebben a kimutatásban sem fog szerepelni.

Hibás jelentések száma: A KELER TR rendszere által formailag befogadott, de logikai hiba miatt elutasított jelentések számát mutatja.

Javított jelentések száma: Az eredetileg hibás, majd javított jelentések összessége.

Jogszába alapján nem jelentett ügyletek száma: Azon jelentéseket tartalmazza, amiket a KELER befogadott, logikai és tartalmi szempontból helyesek, de nem kerültek publikálásra.

Ez két dolog miatt lehetséges:

- az ügyfél a „Trade Publication indicator” mezőben a „0” értéket adta meg, vagy
- a jogszabályban foglaltak alapján az ügyletadatok publikálása nem az adott piaci szereplő, hanem a másik fél kötelezettsége.

Publikált jelentések száma: Azon jelentések száma, amelyeket az adott időszak alatt a KELER közzétett. Gyakorlatilag az összes KELER által befogadott jelentésből le kell vonni azokat, amik hiba miatt elutasításra kerültek, illetve amelyek jogszabály alapján nem kerültek publikálásra, de hozzá kell adni a javított tételeket, így megkapjuk a publikált jelentések számát.

Az egyes számértékekre kattintva egy listában megjelennek a tételes jelentések és adataik. A tételes lista MS Excel-be exportálható.

Működési idő

A kereskedés előtti és utáni közzététel céljából beküldött jelentéseket a KELER minden munkanap reggel 8:00 és 19:00 között publikálja. A megadott időszávon túl beküldött jelentéseket befogadjuk, de azok publikálása csak a következő munkanapon történhet meg.

A jelentések beküldése során jelentkező hiba esetén (legyen szó technikai vagy kommunikációs hibáról), a KELER Service Desk osztálya haladéktalanul értesítést küld az érintett ügyfelek felé. A megküldött értesítés tartalmazza a hiba okának leírását és a várható javítási időt. Amennyiben a hiba előreláthatólag nem javítható a KELER Trade Reporting rendszerének adott napi üzemidején belül, akkor a kapcsolódó BCP folyamat részeként a KELER Service Desk által megküldött értesítés tartalmazni fogja azt a leírást is, hogy mely módon van lehetőség a jelentések KELER felé történő továbbítására. Az elsődleges csatorna ilyen esetekben az e-mailes beküldés, amihez a kapcsolódó e-mail cím a már említett tájékoztatóban megküldésre kerül a Service Desk által.

Amennyiben a közzétételi kötelezettség teljesülése során lép fel hiba, akkor az ügyfelek a normál működés szerint tudják a jelentéseket továbbítani a KELER felé. A közzététel meghúzásáról a KELER a megfelelő csatornákon (pl.: honlapon, elektronikus levélben) tájékoztatja az ügyfeleit.

A piaci szereplők által beküldött jelentések mindaddig várakozó státuszban maradnak, amíg fennálló hiba elhárításra kerül, melynek következtében a beküldött tranzakciós adatok közzétételre kerülnek.

Közös szabályok – kiszervezés

A KELER jelen Értéktári Leirat szerinti szolgáltatásai a vonatkozó jogszabályok szerint az Ügyfél fontos operatív funkciójának kiszervezését jelenti, ezért a KELER és az Ügyfél kötelesek a vonatkozó jogszabályok szerinti kötelezettségek teljesítésére. Ezeket a kötelezettségeket a 2017/565/EU rendelet 31. cikke, valamint a 2007. évi CXXXVIII. törvény (Bsz.) 79-80. cikke tartalmazza, azzal, hogy az utóbbi jogszabály szerinti kötelezettségek csak a magyar illetőségű Ügyfeleinkre vonatkoznak.

A KELER a jelen Értéktári Leiratba foglalt szolgáltatásait nem szervezi ki további szolgáltatóhoz. Kivétel ezen utóbbi szabály alól az, hogy a MiFIR 20-21. cikke szerinti kötelezettségekkel kapcsolatban a közzététel folyamata a Budapesti Értéktőzsde Zrt-hez került kiszervezésre.

A KELER vállalja, hogy megvédi az Ügyfélre, illetve annak ügyfeleire vonatkozó bizalmas információk bizalmas jellegét.

Az Ügyfél tudomásul veszi, hogy a kiszervezés nem eredményezheti a felelősség átruházását az Ügyfél és ügyfelei, valamint felügyeleti engedélye megadása és fennállása vonatkozásában, valamint nem eredményezheti az Ügyfél vezető állású személyei hatáskörének átadását.

A KELER kijelenti, hogy

- a) a kiszervezett funkciók teljesítését támogató megfelelő képességgel, kapacitással, elégséges erőforrással, megfelelő szervezeti felépítéssel és törvényben előírt engedéllyel rendelkezik a kiszervezett funkciók megbízható és szakmai szintű elvégzéséhez;
- b) a kiszervezett szolgáltatásokat hatékonyan és az alkalmazandó törvényeknek és szabályozási követelményeknek megfelelően végzi;
- c) megfelelően felügyeli a kiszervezett funkciók elvégzését, és kielégítően kezeli a kiszervezéssel összefüggő kockázatokat;
- d) minden olyan fejleményről tájékoztatja az Ügyfelet, amely lényeges hatással lehet a kiszervezett funkciók hatékony és az alkalmazandó törvényeknek és szabályozási követelményeknek megfelelő elvégzésére való képességére.

Ellenőrzés

Az Ügyfél jogosult a kiszervezés ellenőrzésére. Az ellenőrzés keretében jogosult adatot kérni a KELER-től, valamint helyszíni ellenőrzést folytatni. Az Ügyfél adatkérési és helyszíni ellenőrzési jogát évente egyszer jogosult gyakorolni, kivéve, ha arra indokolt oka van.

A helyszíni ellenőrzés úgy történik, hogy az Ügyfél a vonatkozó igényét írásban eljuttatja a KELER részére. A KELER a kérelem kézhezvételétől számított harminc napon belül felajánl az Ügyfél számára legalább három egyórás időpontot munkanapon 9-17 óra között, melyek közül az Ügyfél választhatja ki a számára megfelelő időpontot. Az ellenőrzés folytán az Ügyfél kizárólag a KELER APA szolgáltatására vonatkozóan kérhet adatot a KELER-től, illetve bizonyosodhat meg arról, hogy a KELER betartja a vonatkozó jogszabályok szerinti feltételeket. Az ellenőrzéseket követően a felek közös jegyzőkönyvet

vesznek fel az ellenőrzésről. Amennyiben az Ügyfél megfelelési hiányosságait fedez fel, azt köteles feltüntetnie a jegyzőkönyvben. A KELER a jegyzőkönyvben foglalt kifogásokat 30 napon belül, sürgős esetben 8 napon belül megvizsgálja és tájékoztatja az Ügyfelet a KELER által tervezett intézkedésekről.

Amennyiben az Ügyfél illetékes hatósága a kiszervezésre vonatkozó adatszolgáltatásra kötelezi az Ügyfelet és a kötelezettség teljesítéséhez az Ügyfél adatszolgáltatásra hívja fel a KELER-t, úgy a KELER az Ügyféllel egyeztetet formában (írásban vagy e-mail útján) teljesíti az adatszolgáltatást lehetőleg úgy, hogy az Ügyfél az illetékes hatósága által szabott határidőn belül teljesíteni tudja az adatszolgáltatást, de legfeljebb az Ügyfél felhívásától számított harminc napon belül. A KELER köteles együttműködni az Ügyfél illetékes hatóságával a kiszervezett funkciók vonatkozásában.

Az Ügyfél a fenti ellenőrzési jogának gyakorlása folyamán nem ismerhet meg harmadik fél üzleti, értékpapír- vagy banktitkát.

A szolgáltatás értékelése

KELER és Ügyfél folyamatosan figyelemmel kíséri és értékeli a szolgáltatás megfelelő színvonalú ellátása érdekében a szerződésben foglaltak teljesülését. KELER és Ügyfél rendszeresen évente felülvizsgálja a szolgáltatás teljesítését és annak feltételeit, eljárását. A felülvizsgálatra - a rendszeres felülvizsgálat mellett - abban az esetben is sor kerül, ha olyan lényeges változás következik be, mely a szerződés vagy annak mellékleteinek módosítását indokoltá teszi. A szolgáltatás értékelése során KELER és Ügyfél együttműködnek.

Amennyiben a folyamatos monitoring, vagy a felülvizsgálat során KELER és/vagy Ügyfél a szerződéstől, annak mellékleteitől való eltérést, vagy a szolgáltatás nyújtása során bármely hiányosságot állapít meg, KELER és Ügyfél kölcsönösen együttműködve, mind a KELER, mind az Ügyfél érdekeire és kötelezettségeire figyelemmel, egyeztetnek az eltérés, hiányosság rendezésének módjáról, eljárásáról.

Az Ügyfél speciális felmondási jogai

Az Ügyfél az 565/2017/EU rendelet 31. cikk (2) bekezdés g) pontja alapján szükség esetén jogosult megszüntetni a szolgáltatási szerződést azonnali hatállyal, amennyiben az Ügyfél ügyfelének érdeke ezt kívánja. Az Ügyfél ilyen esetben a felmondási nyilatkozatot megfelelő indoklással látja el.

Amennyiben a Bszt. hatálya alatti Ügyfél a kiszervezésnek minősülő megállapodásban foglaltak megsértését állapítja meg, és a kölcsönös egyeztetés nem vezet eredményre, Ügyfél Bszt. 81.§ szerint felszólítja KELER-t a szerződésszerű teljesítésre vagy, ha a szerződésszerű állapot nem állítható helyre, Ügyfél jogosult felmondani a jelen Értéktári Leirat szerinti szolgáltatásra vonatkozó szolgáltatási szerződést.

A kiszervezési megállapodás kötelező bejelentése

A Magyarországi székhellyel rendelkező Ügyfél a befektetési vállalkozásokról és az árutőzsdei szolgáltatókról, valamint az általuk végezhető tevékenységek szabályairól szóló 2007. évi CXXXVIII. törvény 80. § (4) bekezdése alapján az adott szolgáltatási szerződést annak megkötésétől számított három napon belül köteles Megküldeni a Magyar Nemzeti Banknak.

Budapest, 2018. szeptember 12.

KELER Zrt.