



Az order audit trail-hez (RTS24) szükséges új adatok és ajánlati mezők a BÉT derivatív piacán (MMTS II.)

Annak érdekében, hogy a Budapesti Értéktőzsde megfeleljen az RTS24-ben („Maintenance of relevant data relating to orders in financial instruments”) felállított követelményeknek a tagjaitól számos új információt kell bekérnie az ajánlatokhoz kapcsolódóan.

Ellentétben az azonnali piaci (XETRA) megoldással, a derivatív piacon a tőzsde elsősorban a KELER KID (Keler Interface Device) rendszerét fogja használni az új adatok bekérése érdekében. Ez alól csupán egy új adat a kivétel, a végrehajtásért felelős személy (Execution within firm) megadása („Execution ID” mező), melyet közvetlenül a kereskedési rendszeren (MMTS II. K2 interface) keresztül az ajánlat beadás során kell a tagoknak rögzíteni.

A BÉT és a KELER előírja, hogy minden Áru vagy Származékos Szekció tag köteles használni a KELER KID rendszerében rögzíthető pozícióvezetési számlát (PVE) a kereskedéshez. A pozíció vezetési számla azonosító az ajánlatbeadás kötelező eleme a kereskedési rendszerben (kiválasztható listából), kereskedési számla néven, így valósul meg a KID rendszerbe feltöltött adatok és az ajánlatok közötti kapcsolat.

Tehát fontos különbség az azonnali piaci megoldáshoz képest, hogy a KID rendszerben az egyes adatok a különböző pozícióvezetési számlákhoz rendelve kerülnek majd megadásra, nem pedig ajánlati szinten a kereskedési rendszerben. (Ez alól csupán a fent említett „Execution ID” mező a kivétel)

Kereskedési rendszerben rögzítendő adat

Execution ID – Új MMTS II. K2 interface ajánlatbeviteli mező

A mező a következő értékeket veheti fel (nincs titkosítás vagy utólagos short code-long code mapping):

- Algoritmus azonosító – ha az Illetékes Hatóságnál regisztrált és a BÉT-nek előzetesen bejelentett kereskedési algoritmus felel a végrehajtásért és nem egyezik meg a befektetési döntésért felelős algoritmussal. Kizárólag, legfeljebb 8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám adható meg.
- National ID (MiFID által definiált) – ha természetes személy felel a végrehajtásért, és nem egyezik meg kereskedési rendszer azonosítóhoz (felhasználó) bejelentett üzletkötővel.
- Üres – ha az ajánlatot beküldő felhasználóhoz bejelentett természetes személy felel a végrehajtásért
- 3 – ha vagy az ügyfél, vagy saját számlás kereskedés esetén a befektetési döntést meghozó személy/algoritmus (investment decision within firm) felel a végrehajtásért



is. (A BÉT ez esetben a KID rendszerben a pozícióvezetési számlához rögzített National ID-t vagy Algoritmus azonosítót tünteti fel az audit trail riportban)

A tőzsde előre bekéri az összes taghoz tartozó bejelentett üzletkötő National ID-ját, így egy a BÉT rendelkezésére álló adatbázisból az audit trail riportban fel tudja tüntetni üres Execution ID esetén.

Minden kereskedési rendszer felhasználóhoz (beleértve a K2 felhasználókat) kötelező lesz természetes személy bejelentett üzletkötőt rendelni.

Manuális ajánlatbevitel során (MMTS II. Trader Workplace) az Execution ID mező nem tölthető, alapértelmezett értéke „üres”, tehát a bejelentett üzletkötőtől eltérő személy kizárólag K2 interface-en keresztül ajánlatbevitelnél adható meg.

KELER KID PVE rendszerében rögzítendő új adatok (6 darab új mező)

1. Megbízó típus (segédmező)

Csak PVE felvétele esetén szerkeszthető mező, PVE módosításakor nem változtatható.

A mező lehetséges értékei:

- NP - természetes személy (natural person)
- LE – jogi személy (legal entity)
- NC – nem ügyfélmegbízás (no client)
- AGGR – összevont ajánlat (aggregated orders)
- PNAL – függő megbízás (pending allocation)

A mező soha nem maradhat üres, mindig kötelező kitölteni. Alapvetően egy „segéd” mezőről van szó, mely segítséget nyújt az adatok rögzítőjének a megfelelő kitöltésben, az audit trail kitöltésében közvetlenül nem játszik szerepet.

Ha a pozíciósszámlát összevont ügyfélajánlatok kezelésére használja a tag, úgy az 'AGGR' értéket kell rögzíteni, ha függő ügyfélmegbízásokra használja (pl.: ún. omnibusz számla), akkor a 'PNAL' értéket kell felvenni. Fontos, hogy ezek végstátuszok lesznek az audit trail riportban, tehát AGGR vagy PNAL esetén az allokációt és az elszámolást követően sem kell a megbízó adatokat megadni/pótolni.

2. Ügyfél azonosító (Client ID)

PVE felvételekor és módosításakor is szerkeszthető mező.

A mező lehetséges értékei:

- NationalID
- LEI
- Üres
- AGGR
- PNAL

Ez egy szabadon szerkeszthető mező, de két előre rögzített értékkel rendelkezik: AGGR, PNAL



Amennyiben a „Megbízó típus” mező során a NP került rögzítésre, úgy itt az ügyfélhez tartozó MiFID szerinti National ID-t kell rögzíteni.

Ha a „Megbízó típus” mező során LE értéket vettek fel, úgy az ügyfélhez tartozó LEI kódot kell itt rögzíteni.

Ha a „Megbízó típus” mezőben „AGGR” vagy „PNAL” került rögzítésre, akkor ebben a mezőben az előre rögzített ugyancsak AGGR vagy PNAL értéket kell felvenni.

Amennyiben a „Megbízó típus” mező NC, úgy mindig üresen kell hagyni.

Ez nem egy „technikai” mező, azaz az audit trail riportban az ügyfélazonosító az ebben a mezőben feltüntetett értéket fogja megkapni. (Azaz National ID, LEI, AGGR vagy PNAL értéket).

A mezőt maximum 50 karakterrel lehet kitölteni.

3. Algoritmus felel-e a befektetési döntésért (segédmező)

PVE felvételekor és módosításakor is szerkeszthető mező.

A mező lehetséges értékei egy fix értékkészletből:

- 0 – nem algoritmus felel a befektetési döntésért
- 1 - algoritmus felel a befektetési döntésért

Kötelezően töltendő mező, nem maradhat üresen. A mezőt értelemszerűen kell kitölteni, csak saját számlás kereskedéshez rendelt pozícióvezetési számla esetén lehetséges az 1-es érték, ügyfélhez tartozó számla esetén mindig 0-t kell felvennie.

4. Saját számlás befektetési döntésért felelős személy (investment decision within firm)

PVE felvételekor és módosításakor is szerkeszthető mező.

A mező lehetséges értékei:

- National ID
- Algoritmus azonosító
- Üres

Az audit trail során a befektetési döntésért felelős személy az ebben a mezőben feltüntetett értéket fogja megkapni.

A mezőt maximum 50 karakterrel lehet kitölteni.

5. Árjegyzésre használt számla

PVE felvételekor és módosításakor is szerkeszthető mező.

A mező lehetséges értékei egy fix értékkészletből:

- 0 – nem árjegyzői számla
- 1 – árjegyzői számla



Kötelezően töltendő mező, nem maradhat üresen. A mezőt értelemszerűen kell kitölteni, csak saját számlás kereskedéshez rendelt pozícióvezetési számla esetén lehetséges az 1-es érték, ügyfélhez tartozó számla esetén mindig 0-t kell felvennie.

6. Közvetlen elektronikus elérés (DEA)

PVE felvételekor és módosításakor is szerkeszthető mező.

A mező lehetséges értékei egy fix értékkészletből:

- 0 – nem DEA-re használt számla
- 1 – DEA-re használt számla

Kötelezően töltendő mező, nem maradhat üresen. A mezőt értelemszerűen kell kitölteni, csak ügyfélhez tartozó pozícióvezetési számla esetén lehetséges az 1-es érték, saját számlás kereskedés esetén mindig 0-t kell felvennie.

A fent bemutatott 6 új adat a KELER-nél keletkezik meg, majd átadásra kerül minden nap végén a BÉT számára, és ez alapján tudja a tőzsde az audit trail szempontjából szükséges információkat a rendszerében elhelyezett ajánlatokkal összepárosítani.

Az adatok KID rendszerben történő rögzítése mind manuálisan, mind tömeges importtal (KIDIO) lehetséges lesz.

A KELER a tesztkörnyezet felállítását, és az ehhez szükséges specifikációk kialakítását november elején tervezi megvalósítani.

Összefoglaló

Új mezők audit trail miatt és lehetséges értékeik						
Kereskedési rendszerben rögzítendő	KELER KID rendszerben rögzítendő adat					
ExecutionID	Megbízó típus	Ügyfél azonosító	Algoritmus felel a befektetési döntésért	Saját számlás befektetési döntésért felelős személy	Árjegyzésre használt számla	Közvetlen elektronikus elérés (DEA)
Algoritmus azonosító	NP - természetes személy	NationalID	0 - nem algoritmus felel	NationalID	0 - nem árjegyzésre használt	0 - nem DEA-re használt számla
NationalID	LE - jogi személy	LEI kód	1 - algoritmus felel	Algoritmus azonosító	1 - árjegyzésre használt	1 - DEA-re használt számla
Üres	NC - nem ügyfélmegbízás	Üres		Üres		
3	AGGR - összevont ajánlatok	AGGR				
	PNAL - függő megbízás	PNAL				



Kapcsolódó dokumentumok

- KELER KIDIO leírás
- MMTS II. K2 interface és TW leírás (MiFID verzió)

National client identifiers for natural persons to be used in transaction reports

ISO 3166	Country Name	1st priority Identifier	2nd priority Identifier	3rd priority Identifier
AT	Austria	CONCAT		
BE	Belgium	Belgian National Number (Numéro de registre national — Rijksregisternummer)	CONCAT	
BG	Bulgaria	Bulgarian Personal Number	CONCAT	
CY	Cyprus	National Passport Number	CONCAT	
CZ	Czech Republic	National identification number (Rodné číslo)	Passport Number	CONCAT
DE	Germany	CONCAT		
DK	Denmark	Personal identity code 10 digits alphanumeric: DDDMMYYXXXX	CONCAT	
EE	Estonia	Estonian Personal Identification Code (Isikukood)		
ES	Spain	Tax identification number (Código de identificación fiscal)		
FI	Finland	Personal identity code	CONCAT	
FR	France	CONCAT		
GB	United Kingdom	UK National Insurance number	CONCAT	
GR	Greece	10 DSS digit investor share	CONCAT	
HR	Croatia	Personal Identification Number (OIB — Osobni identifikacijski broj)	CONCAT	
HU	Hungary	CONCAT		
IE	Ireland	CONCAT		
IS	Iceland	Personal Identity Code (Kennitala)		
IT	Italy	Fiscal code (Codice fiscale)		
LI	Liechtenstein	National Passport Number	National Identity Card Number	CONCAT
LT	Lithuania	Personal code (Asmens kodas)	National Passport Number	CONCAT
LU	Luxembourg	CONCAT		
LV	Latvia	Personal code (Personas kods)	CONCAT	
MT	Malta	National Identification Number	National Passport Number	
NL	Netherlands	National Passport Number	National identity card number	CONCAT
NO	Norway	11 digit personal id (Foedselsnummer)	CONCAT	
PL	Poland	National Identification Number (PESEL)	Tax Number (Numer identyfikacji podatkowej)	
PT	Portugal	Tax number (Número de Identificação Fiscal)	National Passport Number	CONCAT
RO	Romania	National Identification Number (Cod Numeric Personal)	National Passport Number	CONCAT
SE	Sweden	Personal identity number	CONCAT	
SI	Slovenia	Personal Identification Number (EMŠO: Enotna Matična Številka Občana)	CONCAT	
SK	Slovakia	Personal number (Rodné číslo)	National Passport Number	CONCAT
All other countries		National Passport Number	CONCAT	