

Ügyfél-tájékoztató

az EMIR jelentéseket érintő módosításokról

2021. január 15.

Tisztelt Ügyfeleink!

Tájékoztatjuk Önöket, hogy a REGIS-TR kereskedési adattár - összhangban az ESMA által közzétett változásokkal¹ - a következő validációs szabály módosításokat lépteti életbe az EMIR jelentésekre vonatkozóan. Ezen szabályváltozások nem érintik a KELER TR általi befogadást, a felsorolt mezők tartalmának helyességéről a kereskedési adattár ad visszajelzést.

Változásban érintett mező	Alkalmazott validációs szabály	Alkalmazás kezdete	
		REGIS-TR teszt környezetében	REGIS-TR éles környezetében
Valuation Timestamp Maturity Date Termination Date Settlement Date Maturity Date of the underlying	A jelenlegi validációs szabályok mellett az időbélyeg értékének későbbinek vagy egyenlőnek kell lennie 2014-02-12-nél.	2021.02.08.	2021.03.08.
Initial Margin Posted	A mező töltése a Collateral Update jelentésekben feltételes lesz: <ul style="list-style-type: none"> - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "OC" vagy "FC", ez a mező kötelezően töltendő. - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "U" vagy "PC", ezt a mezőt üresen kell hagyni. 		
Variation Margin Posted	A mező töltése a Collateral Update jelentésekben feltételes lesz: <ul style="list-style-type: none"> - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "PC", "OC" vagy "FC" és a Variation Margin Received mező nincs töltve, ez a mező kötelezően töltendő. - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "PC", "OC" vagy "FC", és a Variation Margin Received mező töltve van, ezt a mezőt üresen kell hagyni, vagy 0-val kell tölteni. - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "U", ezt a mezőt üresen kell hagyni. 	Tradeld szinten: 2021.02.08. Portfolio szinten: 2021.05.24.	Tradeld szinten: 2021.03.08. Portfolio szinten: 2021.06.21.
Initial Margin Received	A mező töltése a Collateral Update jelentésekben feltételes lesz: <ul style="list-style-type: none"> - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "FC", ez a mező kötelezően töltendő. - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "OC", ezt a mezőt üresen kell hagyni. 		

¹ <https://www.esma.europa.eu/policy-rules/post-trading/trade-reporting>

Változásban érintett mező	Alkalmazott validációs szabály	Alkalmazás kezdete	
		REGIS-TR teszt környezetében	REGIS-TR éles környezetében
Variation Margin Received	A mező töltése a Collateral Update jelentésekben feltételes lesz: <ul style="list-style-type: none"> - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "PC", "OC" vagy "FC" és a Variation Margin Posted mező nincs töltve, ez a mező kötelezően töltendő. - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "PC", "OC" vagy "FC", és a Variation Margin Posted mező töltve van, ezt a mezőt üresen kell hagyni, vagy 0-val kell tölteni. - Amennyiben a Collateralisation mező értéke "U", ezt a mezőt üresen kell hagyni. 		
Clearing Obligation	Az új ellenőrzés azt is vizsgálja, hogy az ügylet megkötésének időpontjában a Venue mezőben megadott MIC kód szabályozott piacot, vagy harmadik ország olyan piacát jelöli, amely szabályozott piaccal egyenértékűnek tekinthető. Amennyiben nem, a mezőt "Y" vagy "N" értékkel kell jelölni. Ha az információ nem áll rendelkezésre, "X" érték elfogadható.		
Intragroup	Az új ellenőrzés azt is vizsgálja, hogy az ügylet megkötésének időpontjában a Venue mezőben megadott MIC kód szabályozott piacot, vagy harmadik ország olyan piacát jelöli, amely szabályozott piaccal egyenértékűnek tekinthető. Amennyiben nem, a mező "Y" vagy "N" értékkel tölthető.		

Másik fontos változás, hogy 2021. június 21-től a Collateral Update jelentésekben is szerepeltethető a Collateralisation és a Collateral Portfolio mező. Ennek következtében a Collateralisation mező módosítható lesz a Collateral Update üzenet segítségével. Ezen változás viszont érinteni fogja a beküldhető jelentésekre vonatkozó sémát, a Collateral Update jelentés formátuma megváltozik.

Az új sémával kapcsolatban a későbbiekben nyújtunk tájékoztatást, azt követően, hogy a kereskedési adattár pontosítja az általa elvárt formai követelményeket.

Amennyiben kérdésük, észrevételük lenne a közzétett változásokkal kapcsolatban, kérjük, jelezzék azt a tradereporting@keler.hu e-mail címen.

Üdvözlettel:
KELER Zrt.