

Ügyféltájékoztató

az EMIR REFIT fejlesztést érintő változásokról

2024. március 25.

Tisztelt Ügyfeleink!

Ezúton szeretnénk tájékoztatni Önöket a KELER Trade Reporting EMIR szolgáltatásával kapcsolatos legújabb információkról és változásokról.

Az új követelmények szerinti jelentési kötelezettség 2024.04.29-től lép hatályba. A jelentéstételre kötelezettek és a jelentendő tranzakciók köre nem fog változni, így továbbra is a határidős tranzakciók és az abban résztvevő felek maradnak érintve.

Az alábbiakban szeretnénk néhány Ügyfeleinket is érintő általunk fontosnak ítélt információt, pontosítást megosztani Önökkel.

1. Meglévő CLC kód frissítése EMIR REFIT szabvány szerint

2024.04.29. után amennyiben az 'Other counterparty' nem rendelkezik LEI kóddal, úgy a 'Counterparty2' mezőben úgy kell jelenteni, hogy a 'Counterparty1' mezőben lévő résztvevő fél LEI kódját össze kell vonni a 'Counterparty1' által vezetett egyedi ügyfél-azonosítóval (CLC kód). Az összevonást oly módon kell elvégezni, hogy a 'Counterparty1' LEI kódjához kell hozzáfűzni a 'Counterparty1' által vezetett természetes személy egyedi azonosítóját.

Tekintettel arra, hogy a már beadott, élő jelentések 'Counterparty2' mezőjét nem lehet frissíteni, a KELER által használt kereskedés adattár, a REGIS-TR egy automatikus eljárást dolgozott ki annak érdekében, hogy a nyitott ügyletekkel kapcsolatos, 2024.04.29-ét követően beérkező esetleges módosító életciklus és eredeti jelentések összekapcsolódása zökkenőmentesen megtörténhessen. A REGIS-TR megoldása szerint a 'Counterparty1' mezőben megjelenő 'Counterparty1' LEI kódját és optimális esetben a 'Counterparty2' mezőben megjelenő 'Counterparty1' által adott egyedi azonosítót a REGIS-TR összevonja, és azokból egy új maximum 72 alfanumerikus karakterből álló egyedi azonosítót képez.

Kérjük Ügyfeleinket, hogy az átállást követően az élő jelentésekre vonatkozó módosítások során a fentieket vegyék figyelembe, azaz a Counterparty2 mezőben, amennyiben szükséges (LEI kód hiányában) az összevont azonosítót szerepeltessék!

Az EMIR REFIT rendelet ide vonatkozó része a következő:

„ISO 17442 Jogalany-azonosító (LEI) 20 alfanumerikus karakterkód, amely szerepel a Globális LEI Alapítvány (GLEIF) által közzétett LEI adatállományban, vagy legfeljebb 72 alfanumerikus karakterkód olyan természetes személyek esetében, akik magánszemélyként járnak el, és a ROC-nyilatkozata alapján nem jogosultak jogalany-azonosítóra.

A természetes személyt azonosító kódot az 1. szerződő fél jogalany-azonosítója, és az 1. szerződő fél által szabályozói adatszolgáltatás céljából az adott természetes személy(ek)hez rendelt és következetesen alkalmazott egyedi azonosító együttese alkotja.”

2. CSV file név konvencióra vonatkozó szabályok

A partnereinktől a CSV file-okra vonatkozóan file név konvenció betartását kérjük.

A fájlnev felépítése:

Beküldő partner LEI kódja_EMIR jelentéstípus sémanév azonosító ('auth030' vagy 'auth108')_A jelentéscsomag ActionType értéke 4 karakteren_Időbélyeg másodperc pontossággal (YYYYMMDDHH24MISS)_Sorszám három karakteren, vezető nullákkal feltöltve

pl.: '529900MHIW6Z8OTOAH28_auth030_MODI_20231212130101_001.csv'

- Az Action type értékkészlete:
 - Derivative (auth.030) jelentéscsomag esetén:
{'NEWT', 'MODI', 'CORR', 'TERM', 'EROR', 'REVI', 'VALU', 'POSC'}
 - MarginData (auth.108) jelentéscsomag esetén:
{'MARU', 'CORR'}

3. XML formátumú jelentéscsomag AppHdr->MsgDefldr tartalma

Az ISO 20022 elvárás szerint a „MsgDefldr” értéke

- Derivative (auth.030) jelentéscsomag esetén 'auth.030.001.03_ESMAUG_DATTAR_1.1.0'
- MarginData (auth.108) esetén 'auth.108.001.01_ESMAUG_DATMDA_1.1.0'

4. Jelentéscsomagok tartalma ActionType szerint CSV valamint XML formátumokban

CSV formátumban egy jelentéscsomag csak egyfajta ActionType-hoz tartozó jelentéseket tartalmazhat.

Javasoljuk, hogy egy beküldött XML formátumú jelentéscsomag csak egyfajta ActionType-nak megfelelő jelentéseket tartalmazzon.

5. RptgTmStmp adattal szembeni elvárás

A RptgTmStmp

(xpath:../Document/DerivsTradRpt/TradData/Rpt/Rvv/CtrPtySpfcData/RptgTmStmp)

- nem lehet korábbi, mint a KELER-TR-hoz történő beérkezési napot megelőző naptári nap 00:00 óra;
- az AppHdr-ben szereplő CreDt napjára kell, hogy essen;
- A CreDt értékének ugyanarra a napra kell esnie, mint a Jelentéscsomagban megjelenő Jelentések RptgTmStmp értéke.
- A CreDt legyen nagyobb vagy egyenlő a jelentésekben megjelenő RptgTmStmp maximális értékével.

6. REGIS-TR jelentéscsomag befogadási szabály.

A KELER kereskedési adattár szolgáltatója, a REGIS-TR csak a saját nyitvatartási óráiban fogad be jelentés csomagot, mely időpontról annak végleges meghatározását követően tudunk bővebb tájékoztatást adni. Szolgáltatónk a nyitvatartási órákban beérkezett jelentéscsomagokra vizsgálja, hogy a RptgTmStmp értéke (lásd 5. pont) későbbi időpont legyen, mint a REGIS-TR-hoz történő beérkezést megelőző naptári nap nulla órája.

Ebből következően a REGIS-TR vissza fogja utasítani azokat a jelentéseket, amelyek hétvégét illetve munkaszüneti napot megelőzően napvégén (zárás után) jöttek létre, a létrehozás napjának megfelelő RptgTmStmp értékkel és már nem volt lehetőség azokat a REGIS-TR aznapi nyitva tartási órák alatt eljuttatni REGIS-TR-ba. A REGIS-TR által megküldött státusz üzenetet a KELER TR rendszere továbbítja Ügyfeleink részére.

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

Üdvözlettel:

KELER Zrt.