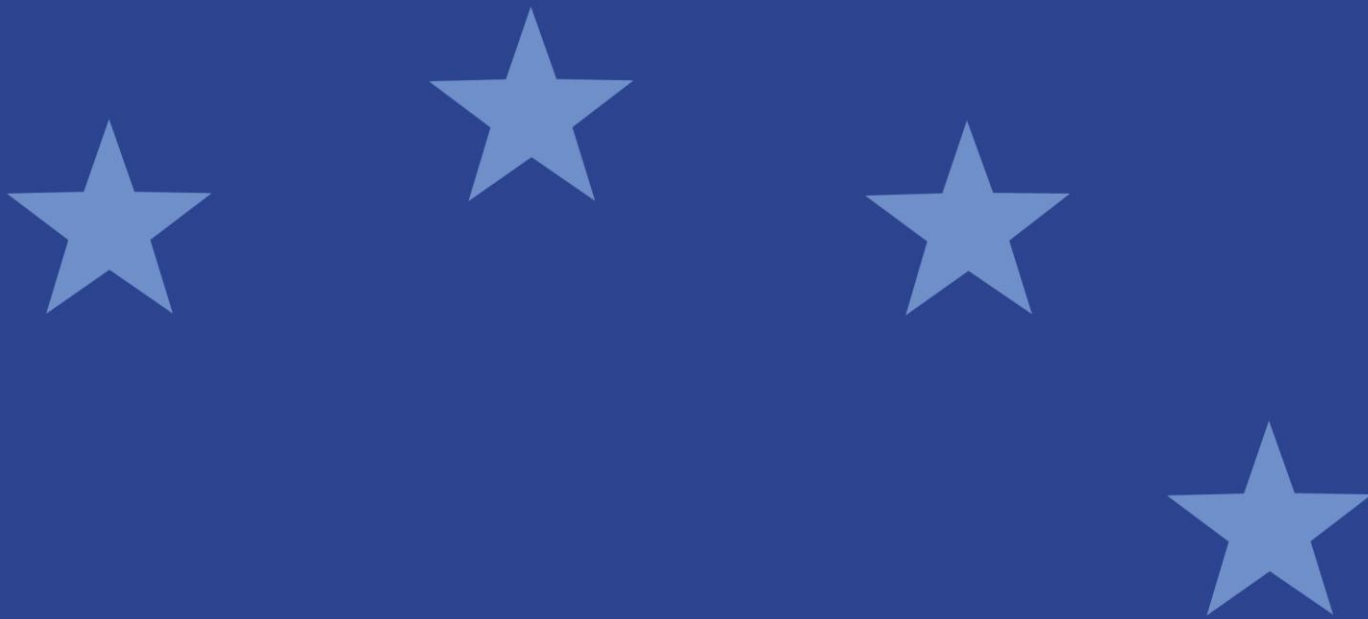




European Securities and
Markets Authority

Iránymutatás

Ügyletek jelentése, megbízások nyilvántartása és az órák összehangolása a MiFID II alapján



Tartalom

Tartalom.....	3
Összefoglaló	9
1 Hatály	10
2 Fogalommeghatározások.....	11
3 Cél.....	12
4 Megfelelési és beszámolási kötelezettségek.....	13
5 Az ügyletjelentésre vonatkozó iránymutatások.....	14
I. rész – Általános elvek.....	16
5.1 Az adatszolgáltatás általános megközelítésben	16
5.2 Kereskedési szerep	18
5.2.1 Saját számlára történő kereskedés (DEAL).....	18
5.2.2 Saját kitettség nélküli ügyletpárosítás (MTCH)	21
5.2.3 Kereskedés "egyéb szerepben" (AOTC)	22
5.2.4 A kereskedési szerepek korlátozásai	23
5.3 Láncok és továbbítás	24
5.3.1 Általános rendelkezések	24
5.3.2 Lánc, amelyben a vállalkozás saját számlára kereskedik vagy saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végez.....	25
5.3.3 Továbbítás	25
5.4 Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen.....	26
5.4.1 A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja (3. mező).....	27
5.4.2 A helyszín mező adatszolgáltatása láncok esetében (36. mező).....	27
5.5 A felek azonosítói.....	27
5.5.1 A CONCAT létrehozásának eljárása	28
5.5.2 Vezeték- és utónév/nevek	30
5.6 Az ügylet fogalma	30
5.6.1 Szerzés és elidegenítés	30
5.6.2 Kizárások a jelentésből	31
5.7 A bejelentés mechanizmusa	35
5.7.1 Nem alkalmazandó mezők és az eszközök referenciaadat-mezőinek kitöltése	35
5.7.2 Ügyletjelentések benyújtása.....	36

II. rész - Blokkok	37
5.8	1. blokk: Eladó/Vevő azonosítása37
5.8.1	A LEI-kódra jogosult vevő/eladó38
5.8.2	Vevő/Eladó természetes személy.....38
5.9	2. blokk: Az Eladó/Vevő nevében döntést hozó személy.....42
5.9.1	A döntéshozó a Vevő/Eladó43
5.9.2	A döntéshozó olyan harmadik fél, aki a Vevőtől/Eladótól képviseleti jogot kapott.43
5.10	3. blokk: (Az 1. és a 2. blokk együtt) Eladóra/Vevőre és döntéshozóra vonatkozó forgatókönyvek45
5.10.1	Vevőknek/Eladónak közös számlája van.....45
5.10.2	Az eladó elhalálozott47
5.11	4. blokk: A vállalkozáson belüli befektetési döntés mező47
5.11.1	A vállalkozáson belüli befektetési döntés47
5.11.2	A befektetési vállalkozáson kívül hozott befektetési döntések (a befektetési döntést az ügyfél hozza, a befektetési vállalkozás pedig saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez vagy "egyéb szerepben" jár el)48
5.12	5. blokk: Végrehajtás a vállalkozáson belül mező48
5.12.1	A végrehajtásért az elsődleges felelősség a személyt terheli49
5.12.2	A végrehajtásért az elsődleges felelősség az algoritmust terheli49
5.13	6. blokk: Kereskedés dátuma és időpontja50
5.14	7. blokk: Helyszín50
5.14.1	Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben50
5.14.2	Ügylet végrehajtása EU-n kívüli kereskedési platformon nem anonim ajánlati könyvben52
5.14.3	Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben szereplő saját ajánlat leütésével53
5.14.4	Ügyletet végrehajtó rendszeres internalizáló54
5.15	8. blokk: Short ügylet jelölése.....55
15.5.1	A befektetési vállalkozás ügyfele rövidre ad el (X vállalkozásnak erről tudomása van)56
15.5.2	X befektetési vállalkozás saját számlán rövidre ad el56
5.16	9. blokk: Mentesség, OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó, valamint az árualapú származtatott termékek megjelölése.....58
5.16.1	Mentesség és OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés ..58

5.16.2	Kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés jelzése olyan esetben, ahol a befektetési vállalkozás két ügyfél ajánlatait OTC piacon párosítja.....	62
5.16.3	Árualapú származtatott termék megjelölése	62
5.17	10. blokk: Fióktelepek	64
5.17.1	Ügyfél nevében végrehajtott ügylet	64
5.17.2	Saját számlára végrehajtott ügylet.....	66
5.17.3	Nem EGK-beli vállalkozások EGK-beli fióktelepe által végrehajtott ügylet.....	68
5.18	11. blokk: Az ügyletjelentések státusza és javítása	69
5.18.1	Törlés és módosítás adott napon belül.....	70
5.18.2	Új ügyletjelentés benyújtása.....	70
5.18.3	Törlés benyújtása	70
5.18.4	Ügyletjelentés információinak helyesbítése	71
5.19	12. blokk: Névleges érték változása	73
5.19.1	Névleges érték növekedése	73
5.19.2	Névleges érték csökkenése.....	76
5.19.3	Lejárat előtti teljes megszűnés	78
III. rész – Kereskedési forgatókönyvek		78
5.20	Értékpapírok átvezetése	78
5.20.1	Átvezetés azonos vállalkozás ügyfelei között	78
5.20.2	Átvezetések két különálló befektetési vállalkozás ügyfelei között	80
5.20.3	Két ügyfél megbízásait OTC piacon párosító vállalkozások.....	82
5.21	Közvetítő befektetési vállalkozás ügyletjelentése	84
5.21.1	Két ügyfél megbízásait közvetítőbefektetési vállalkozás.....	84
5.21.2	Befektetési vállalkozás közbeékelődés nélkül egy másik befektetési vállalkozásnak mutatja be ügyfelét	85
5.22	Egy ügyfél egyetlen megbízásának végrehajtása több ügyletben	86
5.22.1	Ügyfél megbízásának teljesítése kereskedési helyszínen, majd az ügyfél kiszolgálása a befektetési vállalkozás saját könyvéből	86
5.22.2	Ügyfélmegbízás egy részének teljesítése kereskedési helyszínen, majd az eszközök leszállítása az ügyfélnek a befektetési vállalkozás saját könyvéből.....	90
5.23	Megbízások csoportosítása	92
5.23.1	Egy piaci teljesítés több ügyfél számára.....	92
5.23.2	Több piaci teljesítés több ügyfél számára.....	96
5.24	Szervezett kereskedési rendszer (OTF) saját kitétség nélküli ügyletpárosítása	111

5.25	Értékalapú ügyletek kiegyenlítő egységgel	116
5.26	Láncok és továbbítás	120
5.26.1	Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek nem teljesülnek.....	121
5.26.2	Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek teljesülnek, de a 4. cikk nem minden feltétele teljesül	125
5.26.3	Olyan láncok, ahol a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek az összes befektetési vállalkozás megfelel.	134
5.26.4	Olyan láncok, ahol a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek a láncban néhány befektetési vállalkozás megfelel	142
5.27	Több ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozás	156
5.27.1	Több ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozás, amely nem teljesíti a továbbítás feltételeit (összesített megbízások és láncok/átadás kombinációja)	156
5.27.2	A befektetéskezelő diszkrecionális megbízás alapján több ügyfél nevében jár el és teljesíti a továbbítás feltételeit	168
5.28	Közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA)	177
5.28.1	forgatókönyv: a DEA-ügyfél saját számlára kereskedik mögöttes ügyfél nélkül	177
5.28.2	2. forgatókönyv: DEA-ügyfél egy ügyfél nevében jár el.....	180
5.29	Pozíció fedezése különbözeti ügylettel (CFD)	183
5.30	A kereskedési helyszínek MiFIR 26. cikk (5) bekezdés szerinti ügyletjelentési kötelezettsége a saját rendszereiken keresztül teljesített ügyletekre vonatkozóan	186
5.30.1	A vállalkozás saját számlára kereskedik.....	186
5.30.2	Egyetlen ügyfél számára "saját kitétség nélkül ügyletpárosítást" végző vagy "egyéb szerepben" kereskedő vállalkozás	187
5.30.3	Több ügyfél megbízását összesítő vállalkozás	189
5.31	Értékpapír-finanszírozási ügyletek	191
IV. RÉSZ – Különböző eszköztípusok bejelentése		192
5.32	Alapelvek	192
5.33	A kereskedési helyszínen kereskedett vagy az ESMA listában szereplő pénzügyi eszközök azonosítása.....	192
5.34	A kereskedési helyszínen nem kereskedett, illetve az ESMA listájában nem elérhető pénzügyi eszközök azonosítása.....	193

5.34.1	Az EU-n kívüli kereskedési platformon (nem EGK helyszínen) kereskedett pénzügyi eszközök	193
5.34.2	OTC származtatott termékek.....	194
5.35	Konkrét pénzügyi eszközök bejelentése	195
5.35.1	Részvény vagy részvényjellegű eszközök.....	195
5.35.2	Kötvények és az értékpapírosított hitel egyéb formái.....	196
5.35.3	Opciók szerződések	203
5.35.4	Különbözeti ügylet.....	206
5.35.5	Árfolyamkülönbség spekuláció	207
5.35.6	Hitel-nemteljesítési csereügylet.....	213
5.35.7	Csereügyletek	215
A 33.	mezőben feltüntetett árak összhangban kell lennie az instrumentum referenciaadataiban szereplő fix árfolyam értékével.	232
5.35.8	Árualapú származtatott termékek.....	232
5.35.9	Összetett ügyletek.....	237
6	Iránymutatások a megbízások nyilvántartásához.....	241
I. rész – Általános elvek.....		241
6.1	A megbízások nyilvántartási követelményeinek hatálya	241
6.2	Kereskedési helyszín tagjai vagy résztvevői	241
6.3	Ügyfél-azonosító kód (3. mező)	241
6.3.1	A 3. mező (ügyfél-azonosító kód) kitöltése összesített megbízások esetén...242	
6.3.2	A 3. mező (ügyfél-azonosító kódja) kitöltése, amikor az allokáció még nem történt meg	242
6.4	Továbbító bróker (6. mező).....	243
6.5	A megbízás státusza (33. mező).....	243
6.6	Érvényességi időszak dátuma és időpontja (12. mező).....	243
6.7	Passzív vagy agresszív megbízás mutatója (44. mező).....	244
6.8	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja (TVTIC) (48. mező).....	244
6.9	Sorszám (15. mező).....	244
6.10	Érvényességi időszak (10. mező)	248
6.10.1	Nap végéig érvényes megbízást (DAVY) jelölő címke.....	248
6.10.2	Két érvényességi időszakot jelző címke kombinációja: Adott dátumtól érvényes (GADV) és adott dátumig érvényes (GTDV)	248
6.11	Likviditásnyújtási tevékenység (8. mező)	249
II. Rész – Forgatókönyvek		250

6.12	Magyarázat	250
6.13	Központi limitáras ajánlati könyv	251
6.13.1	Új/Törlés/Megbízás módosítása (21. mező)	251
6.13.2	Kiegészítő limitár (25. mező)	255
6.13.3	Iceberg limitár besorolása	256
6.13.4	Peg (vagy kötött) megbízások	259
6.13.5	Stop megbízás besorolása	263
6.13.6	Továbbított megbízás	265
6.13.7	Stratégiai megbízások besorolása (46. mező)	272
6.13.8	Prioritás megváltoztatása	286
6.13.9	Kereskedési fázisok	291
6.14	Jegyzéskérési rendszerek	301
6.14.1	Hogyan tartjuk nyilván a konkrét üzleti partnereknek megküldött jegyzéskérést?	301
6.14.2	Hogyan tartjuk nyilván a jegyzéskérésre korlátozott érvényességi ("vezeték szerinti") idővel adott választ, amelyet az adott jegyzés kérője hajthat végre?	303
6.14.3	Hogyan tartjuk nyilván a jegyzésre adott választ, ha annak a kéréstől eltérő a mennyisége?	304
6.14.4	Hogyan tartjuk nyilván a végrehajtást a jegyzéskérési rendszerben?	305
7	Iránymutatások az órák összehangolásához	307
7.1	Jelentendő események	307
7.2	Az időbélyegző felbontása	307
7.3	A maximális megengedett eltérés mértékére vonatkozó követelmények teljesítése	310
7.3.1	Szökőmásodpercek	311
7.3.2	A helyi idő és az eltolódás az UTC-hez képest	312
7.3.3	A kereskedési helyszínen közvetlen tagsággal vagy részvétellel nem rendelkező befektetési vállalkozásokra vonatkozó joghatály	312
7.4	Alkalmazások, gazda és vezetékes rendszerek időbélyegzői	312
7.5	Az átjárók közötti késleltetés	312
8	Melléletek	314
	I. sz. melléklet: A benyújtó szervezetektől beérkező jelentések feldolgozása	314

Összefoglaló

A közzététel indokolása

Az ügyletek jelentéséről, a megbízások nyilvántartásáról és az órák összehangolásáról szóló (2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet, 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet és 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet ²) szabályozástechnikai standardok tervezetének véglegesítése után az ESMA önálló kezdeményezése alapján elkezdte kidolgozni az említett szabályozástechnikai standardok megvalósítására vonatkozó felügyeleti konvergencia intézkedéseket.

Ez az iránymutatás ennek a munkának az eredményét tükrözi, és a 2015 decemberében közzétett konzultációs dokumentumot követi.³

Tartalom

Az 1., 2. és 3. bekezdés az iránymutatás hatályát, fogalmait és célját határozza meg. A 4. bekezdés az iránymutatás betartásához szükséges eljárást definiálja. Az 5. és a 6. bekezdés a konkrét ügyletekre és a megbízás-nyilvántartási tevékenységre vonatkozó egyedi forgatókönyveket határoz meg. Valamennyi forgatókönyvhöz pontos technikai programutasítások tartoznak, amelyeket a konkrét jelentendő értékek bemutatásánál követni kell. A jelentési és nyilvántartási forgatókönyvek mellett ezek a bekezdések tartalmazzák a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet és a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerinti kötelezettségek alkalmazásával kapcsolatos néhány további, a két SZTS-re vonatkozó konzultáció során a piaci szereplők által kért pontosítást is, ezeket azonban a kérések részletessége és egyedi jellege miatt nem lehetett a standardok végleges változatában tárgyalni. A 7. bekezdés az órák összehangolására (2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet) vonatkozó követelmények alkalmazását illetően tartalmaz pontosításokat.

² Az ESMA által az Európai Bizottsághoz 2015. szeptember 28-án benyújtott technikai standardok (ESMA/2015/1464) az ESMA honlapján az alábbi linken érhetők el: https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/2015-esma-1464_annex_i_-_draft_rts_and_its_on_mifid_ii_and_mifir.pdf

³ Az ügyletek jelentéséről, a referenciaadatokról, a megbízások nyilvántartásáról és az órák összehangolásáról szóló iránymutatással foglalkozó konzultációs dokumentum (ESMA/2015/1909) az ESMA honlapján az alábbi linken érhető el: https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015-1909_guidelines_on_transaction_reporting_reference_data_order_record_keeping_and_clock_synchronisation.pdf

1 Hatály

Alanyi hatály

Az iránymutatás hatálya a befektetési vállalkozásokra, kereskedési helyszínekre, jóváhagyott jelentési mechanizmusokra és az illetékes hatóságokra terjed ki.

Tárgyi hatály

Az iránymutatás tárgyi hatálya az Európai Parlament és a Tanács a pénzügyi eszközök piacairól és a 648/2012/EU rendelet módosításáról szóló 2014. május 15-i 600/2014/EU rendelete⁴ 26. cikkében foglalt ügyletjelentések benyújtására; a megbízásoknak a MiFIR 25. cikke szerinti nyilvántartására és az üzleti óráknak az Európai Parlament és a Tanács 2014. május 15-i 2014/65/EU irányelv (MiFID II)⁵ 50. cikke szerinti összehangolására terjed ki.

Időbeli hatály

Ez az iránymutatás 2018. január 3-tól alkalmazandó.

⁴ Az Európai Parlament és a Tanács 2014. május 15-i 600/2014/EU rendelete a pénzügyi eszközök piacairól és a 648/2012/EU rendelet módosításáról (HL L 173., 2014.6.12., 84. o.).

⁵ Az Európai Parlament és a Tanács 2014. május 15-i 2014/65/EU irányelve a pénzügyi eszközök piacairól, valamint a 2002/92/EK irányelv és a 2011/61/EU irányelv módosításáról (HL L 173., 2014.6.12., 349. o.).

2 Fogalommeghatározások

Az Európai Parlament és a Tanács MiFID II és MiFIR irányelvében használt és az iránymutatásban szereplő fogalmak jelentése azonos. Emellett amikor az iránymutatásban a "vállalkozás" kifejezés szerepel, azon – ellenkező értelmű rendelkezés hiányában – olyan vállalkozás értendő, amely nem a MiFID II szerinti "befektetési vállalkozás".

Amikor az ügyletjelentésekre illetve a megbízások nyilvántartására vonatkozó iránymutatás adott "mezőre" hivatkozik, azon a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet ⁶ I. sz. mellékletének 2. táblázatában illetve, értelemszerűen, a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet mellékletének 2. táblázatában szereplő mezőt kell érteni⁷.

⁶ A Bizottság 2016. július 28-i 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló rendelete a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az ügyletek illetékes hatóságoknak történő bejelentésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről. Elérhető a következő linken:

http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0449.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC

⁷ A Bizottság 2016. június 24-i 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló rendelete a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a pénzügyi eszközökre vonatkozó megbízások lényeges adatainak megőrzésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről. Elérhető a következő linken:

http://eur-lex.europa.eu/legal-content/EN/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0193.01.ENG&toc=OJ:L:2017:087:TOC

3 Cél

Az iránymutatás célja, hogy a befektetési vállalkozások⁸, kereskedési helyszínek⁹, jelentési mechanizmusok¹⁰ és rendszeres internalizálók¹¹ számára útmutatást adjon a MiFIR-irányelvben valamint a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet, 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet és 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet¹² írt bejelentési és nyilvántartási rendelkezések betartásához. Az iránymutatás ezeknek a követelményeknek a következetes alkalmazásáról kíván gondoskodni. Az iránymutatás különösen az ügyletjelentések létrehozására és a megbízások nyilvántartásában a különféle lehetséges forgatókönyvek szerinti adatmezőkre koncentrál. Mivel a lehetséges forgatókönyvek skálája széles, az iránymutatás nem kívánja mindet kimerítően felsorolni. Az iránymutatás hatálya alá tartozó személyek azonban akkor járnak el helyesen, ha a nyilvántartásaik és jelentéseik létrehozásához a leginkább releváns forgatókönyv elemeit használják. Az iránymutató dokumentumban meghatározott fogalmak kizárólag a MiFIR-irányelvnek a megbízási adatok nyilvántartási kötelezettségeiről szóló 25. cikkére és az ügyleti adatszolgáltatási kötelezettségről szóló 26. cikkére valamint a MiFID II irányelvnek az üzleti órák összehangolásáról szóló 50. cikkére vonatkoznak.

Az iránymutatásban használt minden név és vezetéknev fiktív.

⁸ A MiFID II. 4. cikke (1) bekezdésének 1. alpontjában szereplő fogalommeghatározás szerint.

⁹ A MiFID II. 4. cikke (1) bekezdésének 24. alpontjában szereplő fogalommeghatározás szerint.

¹⁰ A MiFID II. 4. cikke (1) bekezdésének 54. alpontjában szereplő fogalommeghatározás szerint.

¹¹ A MiFID II. 4. cikke (1) bekezdésének 20. alpontjában szereplő fogalommeghatározás szerint.

¹² A BIZOTTSÁG 2016.06.07-I 2017/574/EU FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek az üzleti órák összehangolásának mértékét meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről.

4 Megfelelési és beszámolási kötelezettségek

Az iránymutatás jogállása

Ez a dokumentum az EÉPH-rendelet 16. cikkének megfelelő iránymutatásokat tartalmaz. Az ESMA-rendelet 16. cikkének (3) bekezdése szerint az illetékes hatóságok és a pénzügyi piaci szereplők minden erőfeszítést megtesznek azért, hogy megfeleljenek az iránymutatásoknak és az ajánlásoknak.

Az iránymutatás hatálya alá tartozó illetékes hatóságoknak saját felügyeleti gyakorlataik részévé kell tenniük az iránymutatást, ideértve azokat az eseteket is, amikor a dokumentum adott iránymutatásai elsősorban a pénzügyi piaci szereplőkre irányulnak.

Jelentési Kötelezettségek

Az iránymutatások hatálya alá tartozó egyes illetékes hatóságok az ESMA általi közzététel időpontjától számított két hónapon belül kötelesek értesíteni az ESMA-t arról, hogy megfelelnek-e vagy meg kívánják-e felelni a jelen iránymutatásoknak – és ha nem, a meg nem felelés indokairól – a MiFIRreportingGL@esma.europa.eu címen. Amennyiben e határidőn belül nem érkezik válasz, úgy tekintik, hogy az illetékes hatóság nem felel meg az iránymutatásoknak és ajánlásoknak. Az értesítésekhez használandó sablon az ESMA weboldalán található.

A pénzügyi piaci szereplők nem kötelesek bejelenteni, hogy betartják-e ezen iránymutatások rendelkezéseit.

5 Az ügyletjelentésre vonatkozó iránymutatások

Ez az ügyletjelentéssel foglalkozó bekezdés négy részből áll:

- **I. rész – Általános elvek.** Az ügyletjelentésre vonatkozó általános elveket ismerteti. Tárgyalja az ügyletjelentés során beküldendő riport létrehozásának módját, valamint azt, hogy a riportot milyen módon és hova kell beküldeni. Az adatszolgáltatáshoz magas szintű megközelítéseket szolgáltat, és a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (5) bekezdésében meghatározott ügylet jelentésére nézve további útmutatást ad egyes kizárásokról.
- **II. rész – Blokkok.** Ez a rész a blokkokat (mezőkészleteket) tárgyalja, ezen belül az egyes blokkok az adott téma esetén releváns mezőkkel foglalkoznak, és példákat adnak a blokkok kitöltéséhez. A blokkok kialakításuk folytán egymástól függetlenek.
- **III. rész – Forgatókönyvek.** Az adatszolgáltatás során lehetséges különféle kereskedési forgatókönyvek alapján példákat mutat be. Konkrétan ismerteti a megbízások továbbításából, csoportosított megbízásokból és a közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA) biztosításából származó ügyleteket.
- **IV. rész – Pénzügyi eszközök.** Elsősorban a különféle pénzügyi eszközökre ¹³ vonatkozó adatszolgáltatáshoz nyújt útmutatást. A legtöbb példa a származtatott termékekre koncentrál, hiszen ezeknél a pénzügyi eszköznél az adatszolgáltatás szerkezete összetettebb.

Ebben a dokumentumban minden egyes példa mellett megtalálható a hozzá tartozó táblázat, amely a releváns mezőket és az érintett adatok XML szerinti szöveges megjelenítését mutatja. Egyéb közlés hiányában a hozzá tartozó táblázatot és az XML szöveget az alábbiak szerint értelmezzük:

- a) Az "N" illetve a "Mező" a mezőknek a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletének 2. táblázatában található mezők számára illetve nevére utal.
- b) Az "Érték" oszlopban a példa várható betű szerinti értéke jelenik meg. A betű szerinti értékek egyszeres idézőjelek között állnak. Egyes esetekben ehelyett inkább leíró értéket látunk, pl.: "X vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja" Ezeknek a helyére a leírásnak megfelelő aktuális érték kerüljön. Ha a hivatkozás jelzi, az XML szövegben alkalmazzuk a jelmagyarázatban található fiktív tételek értékeit. A zárójeles kifejezések a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletének 1. táblázatában ismertetett adattípusokra utalnak.
- c) Az "Értékek" oszlop üresen hagyott cellái kifejezetten azt közlik, hogy az adott értékek a példával szemléltetett forgatókönyvre nem vonatkoznak, ezért maradjanak üresen.

A kivonatolt XML-szövegek azt mutatják be, hogyan jelenjenek meg az adatok az illetékes hatósághoz benyújtott fájlban. Ugyanakkor az ISO 20022 módszertan végrehajtása érdekében érdemes az üzenetek teljes műszaki leírását tanulmányozni, és csak az itt elérhető teljes műszaki leírás tekinthető az üzenetek helyes specifikációjának:

https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf.

A MiFIR 26. cikk (2) bekezdése alapján a példákban hivatkozott összes eszköz jelentendő pénzügyi eszköznek minősül.

¹³ A MiFID II. 4. cikke (1) bekezdésének 15. alpontjában szereplő fogalom meghatározás szerint.

Az adatszolgáltatást a táblázat kizárólag az adott példában vizsgált felekre mutatja be, ami nem jelenti azt, hogy a példában szereplő egyéb feleknek nincs ügyletjelentési kötelezettségük.

Eltérő közlés hiányában minden időpont UTC idő szerint értendő. Ugyan a dátum és az idő a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet (I. sz. melléklet, 2. táblázat, 28. mező) által előírt minimális felbonthatóság szerint jelenik meg, az időbélyegző felbonthatóságáról szóló 7.2 bekezdésben adott magyarázat szerint azonban nagyobb felbontásban is jelenthető.

Az alapfeltételezés szerint minden kereskedés elektronikus kereskedésnek minősül, a jelentendő idő felbontása szempontjából azonban nem tekintendő HFT-nek.

Kifejezett közlés hiányában a példákban jelentésekkel bemutatott befektetési vállalkozások "egyéb szerepben" járnak el.

Magyarázat:

X vállalkozás (LEI: 12345678901234567890) befektetési vállalkozás.

Y vállalkozás (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) befektetési vállalkozás.

Z vállalkozás (LEI: 88888888888888888888) befektetési vállalkozás.

A ügyfél (LEI: AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA) jogi személy.

B ügyfél (LEI: BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB) jogi személy.

C ügyfél (LEI: CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC) jogi személy.

M kereskedési helyszín (szegmensazonosító MIC: kód 'XMIC'). Ez a kereskedési helyszín anonim ajánlati könyvet működtet a 11111111111111111111 LEI számú központi szerződő féllel¹⁴.

1. ügyfél: természetes személy, Jean Cocteau, francia állampolgár, születési ideje: 1962. június 4. (összefűzött kód: FR19620604JEAN#COCTE).

2. ügyfél: természetes személy, Jose Luis Rodriguez de la Torre, spanyol állampolgár, születési ideje: 1976 február 27. Jose Luis Rodriguez de la Torre spanyol adószáma 99156722T.

1. képviselő: természetes személy, Fabio Luca, olasz állampolgár, költségvetési kódja: ABCDEF1234567890, születési ideje 1974. október 11.

1. kereskedő: Peter Morgan, kanadai állampolgár (útleveleszáma: 1112223334445555), X vállalkozás nevében jár el.

2. kereskedő: Peter Jones, egyesült királyságbeli állampolgár, egyesült királyságbeli nemzeti biztosítási száma AB123456C, X vállalkozás nevében jár el.

3. kereskedő: John Cross, belga állampolgár, nemzeti regisztrációs száma 12345678901, X vállalkozás nevében jár el.

4. kereskedő: Marie Claire, francia állampolgár, születési ideje: 1963. december 2. (összefűzött kódja: FR19631202MARIECLAIR), Y vállalkozás nevében jár el.

5. kereskedő: Juliet Stevens, finn állampolgár, személyazonosító kódja: 311280-888Y, Z vállalkozás nevében jár el.

6. kereskedő: Adam Jones, magyar állampolgár, születési ideje: 1980. április 13. (összefűzött kódja: HU19800413ADAM#JONES), Z vállalkozás nevében jár el.

A helytakarékosság és a példákban szemléltetett fő pontok kiemelése érdekében fontos hangsúlyozni, hogy az egyes példák a hozzájuk tartozó táblázatban és XML szövegekben a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerint ténylegesen kötelező mezők közül csak egy részhalmazzal foglalkoznak. Az adott példában konkrétan nem említett mezőkről nem szabad azt feltételezni, hogy azok nem relevánsak. Adott ügyletre vonatkozóan az összes releváns mezőt jelteni szükséges.

A helyes ügyletjelentések érdekében ezt a dokumentumot tanácsos a MiFID II, a MiFIR valamint a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet, 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet és 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet vonatkozó rendelkezéseivel együtt értelmezni. Az ESMA és az illetékes hatóságok emellett műszaki előírásokat is kiadhatnak.

I. rész – Általános elvek

5.1 Az adatszolgáltatás általános megközelítésben

Az ügyletjelentés célja, hogy az illetékes hatóságokat tájékoztassa az ügyletekről. Az ügyletről olyan ismertetést kíván nyújtani, amely az illetékes hatóságot informálja a mindazokról a releváns körülményekről, amelyek között az ügylet létrejött. Egy-egy ügyletről akár több jelentésben is be kell számolni annak függvényében, mi a befektetési vállalkozás kereskedési szerepe, és hogy ügynök nevében kereskedik-e.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 32. preambulumbekzdésében jelzett feladatainak teljesítéséhez az illetékes hatóságoknak a MiFIR 26. cikkében rögzített ügyletjelentési kötelezettség hatálya alá tartozó ügyletekről pontos és holisztikus ismeretekre van szükségük. A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 11. preambulumbekzdésében pontosított és a 15. cikk (5) bekezdésében tovább részletezett rendelkezések szerint a befektetési vállalkozásnak ezért tanácsos gondoskodnia arról, hogy az ügyletjelentésről általa, mint végrehajtó jogalany által adott kollektív nézet az adott pénzügyi eszközökben lebonyolított jelentendő ügyletek¹⁵ folytán a saját és a saját ügyfelei helyzetében az ügylet végrehajtása idején bekövetkezett összes változást tükrözi. Ha például a befektetési vállalkozás saját számlára szerez meg néhány pénzügyi eszközt, majd ugyanezeket az eszközöket azonos mennyiségben eladja az ügyfelének, a befektetési vállalkozás jelentésében jelezze, hogy a saját nettó terhelése változatlan, és az eszközöket az ügyfél szerezte meg. Ez az elv attól függetlenül érvényes, hogy maga a befektetési vállalkozás illetve valamelyik ARM vagy kereskedési helyszín nyújtja be az összes jelentést vagy azok közül bármelyiket. Az a befektetési vállalkozás például, amely egy adott ügylet piaci oldalának jelentéséhez az adott kereskedési helyszínre támaszkodik, ugyanannak az ügyletnek a piaci oldaláról ne nyújtson be ügyletjelentést. Amikor egy ügyletet ügyfél nevében bonyolít le a befektetési vállalkozás, akkor a jelen iránymutatások alapján ne nyújtson be külön ügyletjelentést az adott ügyletről se saját kitétség nélküli ügyletpárosító szerepében

¹⁵ Érdemes megjegyezni, hogy az ügyletjelentési kötelezettségeknek nem az a célja, hogy a befektetési vállalkozás vagy annak ügyfelei tényleges pozícióját rögzítse. Ami viszont számít, az a pozíciónak a jelentendő ügyletek folytán előálló változása.

se "egyéb szerepben", mert azzal mesterségesen növeli a saját végrehajtású bejelentett ügyleteinek a számát. Továbbá a befektetési vállalkozásnak egy adott ügyletre vonatkozó egyedi jelentései legyenek egymással összhangban, és pontosan tükrözzék a befektetési vállalkozás, az üzleti partnerei és ügyfelei valamint a megbízás alapján az ügyfelek nevében eljáró felek szerepét.

A MiFIR 26. cikk (1) bekezdése szerint azok a befektetési vállalkozások, amelyek pénzügyi eszközökkel ügyleteket teljesítenek, az ilyen ügyletek adatairól mindenre kiterjedő és pontos jelentést tesznek az illetékes hatóságnak. Ez azt jelenti, hogy amikor két befektetési vállalkozás egymással köt ügyletet, mind a kettő benyújtja a saját ügyletjelentését, amelyben az ügyletet a saját szempontjából mutatja be. Ugyanakkor a két befektetési vállalkozás egymásnak megfelelő vonatkozó jelentéseiben a (köztük létrejött ügylet közös tárgyi elemeit ismertető) alábbi mezők tartalom szempontjából egyezzenek: helyszín¹⁶, kereskedés dátuma és időpontja¹⁷, mennyiség, mennyiség pénzneme, ár, ár pénzneme, előrefizetés, előrefizetés pénzneme és adott esetben az eszköz adatai.

A befektetési vállalkozás ügyletjelentése ne csak az ügylet piaci oldaláról tartalmazzon információt, hanem adott esetben az egyes ügyfelekhez való hozzárendelésről is. Ha például az ügyfele nevében eljáró X befektetési vállalkozás egy másik vállalkozástól vagy Y befektetési vállalkozástól pénzügyi eszközöket vásárol, akkor X jelentse, hogy Y-nal X ügyfele nevében kereskedett¹⁸. Ha X saját számlára vásárolja meg a pénzügyi eszközöket, majd az egyik ügyfelének eladja azokat, akkor jár el helyesen, ha az Y befektetési vállalkozástól történő vételt és az ügyfelének történő eladást két külön saját számlás ügyletjelentésben szerepelteti. Hasonló az az eset, amikor a befektetési vállalkozás egy másik vállalkozással vagy befektetési vállalkozással több ügyfelet összesítve hajt végre ügyletet: ilyenkor az a helyes, ha a másik vállalkozással vagy befektetési vállalkozással létrejött összesített (blokk) ügyletet (piaci oldal) és az egyes ügyfelekhez való hozzárendelést (ügyfél oldal) bejelenti.

Két ügyletjelentést ad be például az a befektetési vállalkozás, amely adott kereskedési helyszínen ügyfél nevében saját számlára kereskedik: az egyiket a kereskedési helyszínnel létrejött (piaci oldal), a másikat pedig az ügyféllel teljesült ügyletről (ügyfél oldal). A saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végző illetve az egyetlen ügyfél nevében "egyéb szerepben" eljáró befektetési vállalkozás egyetlen, a piaci és az ügyfél oldalt egyaránt tartalmazó ügyletjelentést adjon be, és abban szerepeltesse az ügyfélre vonatkozó összes mezőt. Ezeket a fogalmakat az alábbi diagram szemlélteti:



Client	Ügyfél
Client Side	Ügyfél oldal
Investment Firm X	X befektetési vállalkozás
Market Side	Piaci oldal

¹⁶ A kereskedési helyszínen végrehajtott ügylet piaci oldalára vonatkozóan (azaz az egyes ügyfelekhez való hozzárendeléssel szemben)

¹⁷ A befektetési vállalkozásokra vonatkozó különböző pontossági követelményeket lásd: 7.2. bekezdés

¹⁸ Hacsak nem teljesíti a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításra vonatkozóan rögzített követelményeket, lásd 5.26. bekezdés.

Investment Firm Y	Y befektetési vállalkozás
Investment Firm Y executed on venue	Y befektetési vállalkozás végrehajtási helyszíne
Trading venue	Kereskedési helyszín

5.2 Kereskedési szerep

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet (29. mező) rögzíti, hogy háromféle bejelenthető kereskedési szerep létezik: saját számlára történő kereskedés, saját kitettség nélkül ügyletpárosítás és "egyéb szerep". A bejelentett kereskedési szerep tükrözzé azt a szerepet, amelyben a befektetési vállalkozás ténylegesen kereskedett, és egyezzen a befektetési vállalkozás ügyletjelentésében/ügyletjelentéseiben található többi információval.

5.2.1 Saját számlára történő kereskedés (DEAL)

A saját számlára történő kereskedést végző befektetési vállalkozás az ügyletjelentésben vagy vevőként vagy eladóként szerepeljen. Az ellenoldali eladó vagy vevő az az üzleti partner, ügyfél vagy kereskedési helyszín¹⁹ lesz, akivel/amellyel a befektetési vállalkozás kereskedik. A befektetési vállalkozás eljárhat tisztán a saját ügyleteinek lebonyolítása érdekében, vagy végezhet saját számlás kereskedést ügyféltől kapott megbízások teljesítése érdekében. Az utóbbi esetben az ügyfél oldali jelentésben a kereskedés dátuma és időpontja lehet azonos a piaci oldali jelentésben szereplő adattal vagy annál későbbi, a piaci oldali és az ügyfél oldali jelentésben az árfolyam lehet azonos vagy eltérő.

5.2.1.1 Kereskedés saját néven

1. példa

X befektetési vállalkozás saját számlára kereskedve M kereskedési helyszínen pénzügyi eszközöket vesz.

X befektetési vállalkozás ezt így jelentse:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI>
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-	</Id> </AcctOwnr> </Buyr>

¹⁹ Lásd a 7. blokkban írtakat.

		azonosító {LEI} kódja	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	

5.2.1.2 Kereskedés ügyfél nevében

2. példa

X. befektetési vállalkozás megbízást kap az egyik ügyfelétől (A ügyfél) pénzügyi eszköz vételére. X. befektetési vállalkozás saját számlára kereskedve az M kereskedési helyszínen vásárolja meg az eszközt, majd ezeket eladja A ügyfélnek.

A fentiek szerint X befektetési vállalkozás különböző jelentéseiben eltérő lehet az árfolyam, pl.: X befektetési vállalkozás 0,352 GBP árfolyamon vehet egy helyszíntől/üzleti partnertől, A ügyfélnek viszont 0,370 GBP árfolyamon adhat el: ilyenkor X befektetési vállalkozás az alábbiak szerint jelentsen:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
4	Végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
33	Árfolyam	'0,352'	'0,370'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF' ²⁰

²⁰ Az 'XOFF' értéknek a helyszín mezőben való használatáról lásd az 5.4. bekezdést.

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.37</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>

3. példa

X befektetési vállalkozás A ügyféltől megbízást kap pénzügyi eszközök vételére, és azt a saját könyvéből teljesíti.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-	<pre> <Tx> <New> ... </pre>

		azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <AcctOwnr>
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr>
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	<Id>
36	Helyszín	XOFF	<LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>

5.2.2 Saját kitettség nélküli ügyletpárosítás (MTCH)

A MiFID II 4. cikk (1) bekezdésének 38. pontja a saját kitettség nélküli ügyletpárosítást olyan ügyletként határozza meg, "ahol a közvetítő a vevő és az eladó közé helyezi magát oly módon, hogy a tranzakció végrehajtása során nincs kitéve piaci kockázatnak (...)". Ezért ajánlatos, ha az ügyletjelentésből kiderül, hogy a végrehajtó befektetési vállalkozásnak a pozíciója az ügylet eredményeképpen nem változik.

Amikor csak egy ügyfél vesz részt az ügyletben, ajánlott egy ügyletjelentést beadni, amelyben a piaci oldalra és az ügyfél oldalra vonatkozó információk egyaránt szerepelnek. Az ügyfelet/ügyfeleket az eladó/vevő mezőbe, a helyszínt és az üzleti partnert viszont az eladó/vevő mezőbe kell felvenni. Ha résztvevő ügyfelek száma egynél több, ajánlott a piaci oldalt az egyes ügyfeleknek jutó allokációt az összesített ügyfélszámla (lásd: megbízások csoportosítása az 5.23. bekezdésben) segítségével a 61. példában bemutatott módon összekapcsolni, az ügyfél oldali jelentések pedig tartalmazzák az összes vonatkozó mezőt.

4. példa

Ha az 5.2.1 bekezdésben bemutatott első példa az M kereskedési helyszínen 2018. június 9-én 09:30:42.124356 időpontban 0,352 GBP árfolyamon valósulna meg, és X befektetési vállalkozás a saját kitettség nélkül ügyletpárosítás szerinti szerepben kereskedne, X vállalkozásnak az alábbiak szerint kellene jelentenie:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
---	------	---------	--------------------

4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 09T09:30:42.124Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-09T09:30:42.124Z'	
29	Kereskedési szerep	'MTCH'	
33	Árfolyam	'0,352'	
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	

5.2.3 Kereskedés "egyéb szerepben" (AOTC)

A saját számlára történő kereskedés és a saját kitettség nélküli ügyletpárosítás fogalmi körébe nem tartozó összes egyéb tevékenység bejelentésében ajánlott kereskedési szerepként az "egyéb szerep" értéket feltüntetni, ami arra az esetre is kiterjed, amikor a kereskedés ügynöki szerepben történik.

5. példa

Az A ügyfél nevében eljáró X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínen pénzügyi eszközöket vesz. Az ügyletet 2018. június 9-én 09:30:42.124356 időpontban 0,352 GBP árfolyamon hajtja végre.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
---	------	---------	--------------------

4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ...
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr>
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-09T09:30:42.124Z'	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	</Sellr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
33	Árfolyam	'0,352'	</Sellr> ...
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	<Tx> <TradDt> 2018-06-09T09:30:42.124Z </TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ...
			<Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ...
			<TradVn>XMIC</TradVn> ...
			</Tx> ...
			</New> </Tx>

Ez az ügyletjelentés a kereskedési szerep mezőben feltüntetett értéktől eltekintve ugyanolyan, mint amely akkor készülné, ha X befektetési vállalkozás szerepe szerint saját kitétséggel nélküli ügyletpárosítást végezne.

5.2.4 A kereskedési szerepek korlátozásai

A saját számlára kereskedő vagy saját kitétséggel nélküli ügyletpárosítást végző befektetési vállalkozás közvetlenül maga jár el, és a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikke szerint "megbízást nem továbbíthat", mert ha valamelyik megbízását más vállalkozáshoz vagy befektetési

vállalkozáshoz nyújtja be, az a saját megbízásának és nem az ügyféltől kapott megbízás továbbításának minősül, és nem tekinthető olyan megbízásnak sem, amely az ügyféltől kapott diszkrécionális megbízás alapján valamilyen pénzügyi eszköz megszerzéséről vagy elidegenítéséről hozott döntésből következik. Ezért amikor a befektetési vállalkozás megbízást továbbít, de nem felel meg a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításról rögzített feltételeknek, akkor az ESMA csak azt várja el, hogy az adott vállalkozás "egyéb szerep" szerint jelentsen.

Az 5.28. bekezdésben említettek szerint a közvetlen elektronikus hozzáférést biztosító szolgáltató azt jelentse be, hogy AOTC vagy MTCH szerepben jár el.

5.3 Lánckok és továbbítás

5.3.1 Általános rendelkezések

A jelentések láncja akkor alakul ki, amikor egy vállalkozás vagy befektetési vállalkozás az ügyletet nem saját maga teljesíti, hanem teljesítésre egy másik vállalkozásnak vagy befektetési vállalkozásnak továbbítja a megbízást. Ebbe a körbe tartozik az a helyzet, amelyben egy vállalkozás vagy befektetési vállalkozás

- (i) a saját megbízását küldi el egy vállalkozásnak teljesítésre;
- (ii) az ügyféltől kapott megbízást küldi el egy másik vállalkozásnak vagy befektetési vállalkozásnak teljesítésre, vagy
- (iii) ügyféltől kapott diszkrécionális megbízás alapján dönt egy pénzügyi eszköz megszerzéséről vagy elidegenítéséről, és a megbízást egy másik vállalkozásnál vagy befektetési vállalkozásnál helyezi el.

Azt az esetet kivéve, amikor a megbízást a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikke szerint továbbítják, az ügyletjelentési kötelezettsége szempontjából nincs jelentősége annak a ténynek, hogy egy befektetési vállalkozás egy láncban szerepel, attól eltekintve, hogy a megbízását nem a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében rendelték szerint továbbító befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha ügyletjelentésében feltünteti a megbízást teljesítő vállalkozás vagy befektetési vállalkozás által visszaigazolt mennyiséget, árfolyamot, végrehajtási dátumot és időpontot (lásd: 5.27.1.2.). A befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha a láncból kizárólag a saját "részét" jelenti, tehát nem kell a láncban a saját üzleti partnerén és ügyfelén túlra előre vagy hátrafelé tekintenie. Amikor a lánc részét képző befektetési vállalkozás a fenti bekezdés ii. és iii. pontja alapján végzi a tevékenységét miközben a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében rögzített feltételek nem teljesülnek, az ügyletjelentés ugyanúgy történik²¹, mint amikor a befektetési vállalkozás az ügylet teljesítéséhez közvetlenül egy kereskedési helyszínnel vagy piaci üzleti partnerrel vagy ügyfél kereskedik (lásd: jelen iránymutatások III. részének 5.26.2. albekezdése).

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításra vonatkozó feltételek vállalkozásokra nem terjednek ki. Ezért, amikor egy befektetési vállalkozás egy vállalkozástól kap megbízást, vevőként/eladóként azt a vállalkozást jelentse, amelyik a megbízást küldte, és ne a vállalkozás mögött álló ügyletet. Ez vonatkozik a nem befektetési vállalkozásnak minősülő befektetéskezelő vállalkozástól kapott megbízásokra is. A megbízást átvevő befektetési vállalkozás a

²¹ Bár a megbízás továbbítását jelző mező kitöltése másképp történik.

befektetéskezelő vállalkozást és ne a mögötte álló alapot/ügyleteket jelölje meg, mint ügyletet (vevőt/eladót).

5.3.2 Lánc, amelyben a vállalkozás saját számlára kereskedik vagy saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez

A saját számlára kereskedő vagy saját kitétség nélküli ügyletpárosítást végző befektetési vállalkozás közvetlenül maga jár el, és nem minősül megbízást továbbító befektetési vállalkozásnak, mert ha egy vállalkozásnak vagy befektetési vállalkozásnak megbízást küld, az saját megbízásnak minősül, és nem tekinthető sem ügyféltől kapott megbízás továbbításának, sem olyan megbízásnak, amely az ügyféltől kapott diszkrecionális megbízás alapján valamilyen pénzügyi eszköz megszerzéséről vagy elidegenítéséről hozott döntésből következik. A példákat lásd az iránymutatások III. részének **Error! Reference source not found.** albekezdésében.

5.3.3 Továbbítás

Az a befektetési vállalkozás, amely a fenti 5.3.1. bekezdés ii. és iii. pontja szerinti tevékenységet végzi, választhat: betartja a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt továbbítási feltételeket, vagy jelenti az ügyletet.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 3. cikk (2) bekezdése alapján "egy befektetési vállalkozás nem tekinthető úgy, hogy ügyletet hajtott végre, ha a 4. cikknek megfelelően megbízást továbbított". A fogadó vállalkozás a jelzett konkrét adatokkal töltsse ki az ügyletjelentésében a táblázat mezőit. A fogadó vállalkozás ezt szokásos adatszolgáltatása részeként tegye, nem szükséges ARM-mé válnia.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerint (lásd 7. 16. és 25. mező) amikor a befektetési vállalkozás az 5.3.1. bekezdés ii. és iii. pontjának megfelelő tevékenységet végez, s ekközben ugyanennek az SZTS-nek a 4. cikkében a továbbításról rögzített feltételek nem teljesülnek, akkor a vállalkozás jelentse be az ügyletet, és a megbízás továbbítását jelző mezőben az "igaz" értéket tüntesse fel. A fogadó befektetési vállalkozás a továbbító befektetési vállalkozást vevőként/eladóként jelentse. Hiszen olyan esetben, ahol a továbbító befektetési vállalkozás ügyfelének adatszolgáltatási kötelezettsége áll fenn, az ügyfél akkor jár el helyesen, ha inkább a továbbító befektetési vállalkozást és nem a fogadó befektetési vállalkozást jelöli meg vevőjeként/eladójaként (az 5.26.3.3. pontban látható módon).

Amikor a befektetési vállalkozás nem szervezett kereskedési rendszernek minősülő kereskedési helyszínen saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez vagy saját számlára kereskedik, akkor az adott befektetési vállalkozás nem továbbít, hiszen a megbízást nem adja át másik befektetési vállalkozásnak, hanem a kereskedési helyszínen közvetlenül saját maga hajtja végre, ezért a 25. mezőbe a 'false' (hamis) érték kerüljön.

A továbbítási követelményeket "mindent vagy semmit" alapon alkalmazzuk, ami azt jelenti, hogy amennyiben a megbízást küldő vállalkozás nem adja át a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt továbbítási feltételek teljesüléséhez szükséges összes információt, akkor a fogadó befektetési vállalkozás az ügyletet úgy jelenti, mintha nem történt volna továbbítás.

Nem változtat a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 14. cikkének alkalmazásán az, ha a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt továbbítás

bekövetkezik, tehát a fogadó befektetési vállalkozás az ügyletjelentését a székhely szerint illetékes hatóságnak küldi.

Adott befektetési vállalkozás fióktelepei között nem létezik továbbítás, mert a fióktelep nem önálló jogi személy. Ezzel ellentétben, amikor a továbbítás egy csoporton belül különböző jogi személyek között valósul meg, e jogi személyekre ugyanazok az adatszolgáltatási követelmények vonatkoznak, mintha nem is lennének kapcsolt befektetési vállalkozások illetve vállalkozások.

A 25. mező (Megbízás továbbításának jelzése) célja, hogy jelezze, egy láncon belül egy másik befektetési vállalkozás felé a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételek teljesülése nélkül történt továbbítás. Az ügynöki szerepben eljáró továbbító befektetési vállalkozás a 25. mezőben az "igaz" értéket tüntesse fel függetlenül attól, hogy a továbbításra sikertelen kísérletet tett-e, vagy egyszerűen eltekintett a továbbítástól.

A fentiek fényében a 25. mező kitöltése során az alábbiakat tanácsos figyelembe venni:

1. Nem készít jelentést a befektetési vállalkozás, amikor megbízást továbbít, és a 4. cikk összes feltételét teljesíti.
2. Amikor a befektetési vállalkozás közvetlenül olyan kereskedési helyszínen kereskedik, amely nem olyan OTF, amely egyező tőke vagy saját számlás alapon működik, a 25. mezőben (Megbízás továbbításának jelzése) a 'false' (hamis) érték álljon.
3. Amikor a befektetési vállalkozás szerepe szerint saját számlára kereskedik, vagy saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez (29. mező = 'DEAL' / 'MTCH'), a 25. mezőben (Megbízás továbbításának jelzése) a 'false' (hamis) érték álljon.
4. Amikor a befektetési vállalkozás a megbízásokat továbbítja az ügyfelektől, vagy megbízásokat köt ügyfelei részére diszkrecionális mandátum alapján anélkül, hogy teljesítené a 4. cikk feltételeit, akkor jelentésében azt jelezze, hogy egyéb kereskedési szerepben jár el (29. mező = 'AOTC'), a 25. mezőben pedig a 'true' (igaz) érték álljon.
5. Bármely egyéb esetben, amikor a befektetési vállalkozás egyéb kereskedési szerepben jár el (29. mező = "AOTC"), a 25. mezőben a 'false' érték álljon.

5.4 Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen

A 36. mező értelmezésében csak akkor minősül az ügylet egy kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletnek, amikor

- i) a két fél vételi és eladási érdekét a kereskedési helyszín kapcsolja össze akár diszkrecionális, akár nem diszkrecionális alapon.

vagy

- ii) a két fél vételi és eladási érdekét a kereskedési helyszín sem diszkrecionális, sem diszkrecionális alapon nem kapcsolja ugyan össze, de az ügyletre mégis kiterjednek a kereskedési helyszín szabályai, és az e szabályok szerint teljesül.

Amikor a befektetési vállalkozás nem a piaccal közvetlenül szembesülő jogalany, akkor az ügyletjelentés szempontjából nem minősül a kereskedési helyszínen végrehajtó vállalkozásnak.

5.4.1 A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja (3. mező)

A 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 12. cikke alapján "a kereskedési helyszínek üzemeltetői kötelesek egyedi kereskedési helyszín ügyletazonosító kódot nyilvántartani" a párosítási rendszerükben feldolgozott megbízások teljes vagy részleges végrehajtása nyomán létrejött minden egyes ügyletről. Erre a kereskedési helyszín ügyletazonosító kódra (TVTIC) hivatkozik a 3. mező a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet-ben, amely előírja, hogy a befektetési vállalkozás köteles ebben a mezőben a kereskedési helyszín üzemeltetője által "a kereskedési helyszínen végrehajtott ügylet piaci oldalához" előállított megfelelő TVTIC kódot feltüntetni.

A kereskedési helyszínek üzemeltetői olyan ügyletekhez is létrehozhatnak TVTIC kódot, amelyek a "kereskedési helyszínen végrehajtott" fogalom előző bekezdésben megadott meghatározásának ii. pontja alá tartozik, ha a TVTIC kód előállítása e körülmények között történik és a befektetési vállalkozás a TVTIC kódot a kereskedési helyszíntől kapja, ilyenkor a befektetési vállalkozás dönthet úgy, hogy a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 3. mezőjében a kereskedési helyszín által létrehozott TVTIC kódot tünteti fel.

5.4.2 A helyszín mező adatszolgáltatása láncok esetében (36. mező)

Ha az ügyletjelentés olyan ügyletkezhez készül, amelyet a fenti 5.4. bekezdésben írt pontosítás szerinti kereskedési helyszínen, rendszeres internalizálóval vagy az unión kívüli szervezett kereskedési platformon hajtanak végre, akkor a piaci oldali jelentés 36. mezőjében az adott helyszín, kereskedési platform vagy rendszeres internalizáló MIC kódja álljon. A lánc összes többi jelentésében az "XOFF" érték szerepeljen.

5.5 A felek azonosítói

A LEI-re jogosult jogalanyok azonosítása a MiFIR 26. cikk (6) bekezdése valamint a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 5. cikke és I. melléklete alapján LEI kóddal történjen. Konkrétan e jogalanyok közé társulások, polgári jogi társaságok, szövetségek és üzleti minőségben eljáró magánszemélyek tartoznak²². A fióktelepet a központ LEI kódjával kell azonosítani még akkor is, ha egyes esetekben a fióktelep maga is jogosult lehet LEI kódra²³.

Ugyan elvárás a végrehajtó befektetési vállalkozással szemben, hogy a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 5. cikkének (2) bekezdése alapján a globális jogalany-azonosító rendszerek helyi működési egységeinek feltételei szerint intézkedjen a saját LEI kódjának megújításáról, a 13. cikk (3) bekezdése sem az ügyfél, sem az üzleti partner LEI kódjának megújításáról nem gondoskodik.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 6. cikke kimondja, hogy a természetes személyt az SZTS II. mellékletében felsorolt nemzeti azonosítóval kell azonosítani. Fontos, hogy a MiFIR 26. cikk (1) bekezdésének rendelkezése szerint a befektetési vállalkozások mindenre kiterjedő

²² Az üzleti minőségben eljáró magánszemély a MiFID 4. cikk (1) bekezdés 1. albekezdésében meghatározott konkrét feltételek között befektetési vállalkozásnak minősül. Az üzleti minőségben eljáró magánszemélyekkel kapcsolatos további részleteket lásd: LEI Szabályozás-felügyeleti Bizottságának nyilatkozata (http://www.leiroc.org/publications/gls/lo_u_20150930-1.pdf).

²³ A LEI Szabályozás-felügyeleti Bizottságának 2016. július 11-i nyilatkozata szerint egyes fióktelepek jogosultak lehetnek LEI kódra a nyilatkozatban írt feltételek teljesülése esetén. További részleteket lásd: LEI Szabályozás-felügyeleti Bizottságának nyilatkozata (http://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20160711-1.pdf).

és pontos jelentést tesznek az ügyletek adatairól. Tekintve, hogy a természetes személyek azonosítói az ügyletekről készült jelentés adatai között szerepelnek, a kiterjedő és pontos jelentés kötelezettsége ugyanígy kiterjed a természetes személyek azonosítóira is. E követelmény teljesítése érdekében a befektetési vállalkozás többek között felkérhetné a természetes személyt, hogy hivatalos okmányok átadásával igazolja az azonosító helyességét és érvényességét. Amikor az ügyfél nem ad azonosítót, a befektetési vállalkozás képtelen az ügyletjelentési kötelezettségek e részletének eleget tenni.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 6. cikk (3) bekezdése nem határoz meg olyan természetes személyt, aki egynél több nem EGK ország állampolgára. Ezeket az eseteket tanácsos az több EGK állampolgársággal rendelkező személyeknél használt eljárással azonos módon tisztázni.

5.5.1 A CONCAT létrehozásának eljárása

A CONCAT kódot tilos alapértelmezés szerinti azonosítóként használni olyan országok esetében, amelyek a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet II. mellékletében található táblázat szerint nem jelölték meg a CONCAT kódot a három elsőbbséget élvező lehetőség között.

A CONCAT előállításához tanácsos az alábbi négylépéses eljárást alkalmazni:

1. A vezetéknev és utónév beszerzése

Az elírás veszélyének és a rövidítések használatának csökkentése érdekében a befektetési vállalkozásnak tanácsos meggyőződnie arról, hogy a személy teljes nevét helyesen írta-e le. Rövidített formát és összevonást használni tilos.

2. Címek eltávolítása

A nevek előtt álló, címet, beosztást, szakmát vagy tudományos végzettséget jelölő előtagot el kell távolítani. Hasonlóképpen el kell távolítani többek között az alábbi listában szereplő előtagokat azzal, hogy a lista nem tesz különbséget kis- és nagybetű között:

atty, coach, dame, dr, fr, gov, honorable, madam(e), maid, master, miss, monsieur, mr, mrs, ms, mx, ofc, ph.d, pres, prof, rev, sir

3. Eltávolítandó előtagok

am, auf, auf dem, aus der, d, da, de, de l', del, de la, de le, di, do, dos, du, im, la, le, mac, mc, mhac, mhíc, mhic giolla, mic, ni, ní, níc, o, ó, ua, ui, uí, van, van de, van den, van der, vom, von, von dem, von den, von der

Tilos eltávolítani a vezetékneveknek a fenti listán nem szereplő előtagjait, illetve a névvel egybeírt előtagot, pl. McDonald, MacChrystal, O'Brian, O'Neal, megjegyzendő azonban, hogy az aposztróf a következő lépésben kiesik. A fenti lista nem tesz különbséget kis- és nagybetű között.

4. Aposztróf, ékezet, kötőjel, szóköz és hasonló jelek átírása

A vezeték és utónevek betűről betűre történő átírásához az alábbi táblázatot érdemes használni. Általánosságban az átírás nem érinti az angol ábécé A-tól Z-ig illetve a-tól z-ig terjedő betűit, és eltávolítja az összes mellékjelet, aposztrófot, kötőjelet, írásjelet és szóközt.

Átírási táblázat

A következő táblázat egyetlen bejövő betűt egyetlen kimenő betűnek feleltet meg. Ezt a táblázatot a vezeték és utónevekre a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 6. cikk (4) bekezdésében írtak szerint az első öt betű kinyerése előtt helyes alkalmazni.

A cirill, a görög vagy egyéb nem-latin ábécé betűivel írt nevek helyett, bevett latin írásmód hiányában, az átírt angol változatot használjuk az adott ábécé esetében érvényes konvenciók szerint.

Kimenet	Bemenet:	Bemeneti Unicode kódpont
A	Ä ä À à Á á Â â Ã ã Ä ä Ă ă Ȧ ȧ Ǽ æ	U+00C4 U+00E4 U+00C0 U+00E0 U+00C1 U+00E1 U+00C2 U+00E2 U+00C3 U+00E3 U+00C5 U+00E5 U+01CD U+01CE U+0104 U+0105 U+0102 U+0103 U+00C6 U+00E6
C	Ç ç Ć ć Ĉ ĉ Ċ ċ	U+00C7 U+00E7 U+0106 U+0107 U+0108 U+0109 U+010C U+010D
D	Đ đ Ð ɖ ɔ	U+010E U+0111 U+0110 U+010F U+00F0
E	È è É é Ê ê Ë ë Ě ě Ę ę	U+00C8 U+00E8 U+00C9 U+00E9 U+00CA U+00EA U+00CB U+00EB U+011A U+011B U+0118 U+0119
G	Ĝ ĝ Ğ ğ Ğ ğ	U+011C U+011D U+0122 U+0123 U+011E U+011F
H	Ĥ ĥ	U+0124 U+0125
I	İ i Í í Î î Ī ī Ĭ ĭ	U+00CC U+00EC U+00CD U+00ED U+00CE U+00EE U+00CF U+00EF U+0131
J	Ĵ ĵ	U+0134 U+0135
K	Ƙ ƙ	U+0136 U+0137
L	Ł ł Ⱥ Ȼ ȼ Ƚ	U+0139 U+013A U+013B U+013C U+0141 U+0142 U+013D U+013E
N	Ñ ñ Ȧ ħ Ń ń	U+00D1 U+00F1 U+0143 U+0144 U+0147 U+0148
O	Ö ö Õ õ Ó ó Ô ô Õ õ Ö ö ø Ø œ œ	U+00D6 U+00F6 U+00D2 U+00F2 U+00D3 U+00F3 U+00D4 U+00F4 U+00D5 U+00F5 U+0150 U+0151 U+00D8 U+00F8 U+0152 U+0153
R	Ŕ ŕ Ŗ ŗ	U+0154 U+0155 U+0158 U+0159
S	ß ß Ś ś Š š Š š Š š Š š	U+1E9E U+00DF U+015A U+015B U+015C U+015D U+015E U+015F U+0160 U+0161 U+0218 U+0219
T	Ŧ ŧ Ț ț Ȣ ȣ Ȥ ȥ	U+0164 U+0165 U+0162 U+0163 U+00DE U+00FE U+021A U+021B
U	Ü ü Û û Ú ú Ů ů Ű ű Ū ū ū Ȯ ȯ Ŭ ŭ	U+00DC U+00FC U+00D9 U+00F9 U+00DA U+00FA U+00DB U+00FB U+0170 U+0171 U+0168 U+0169 U+0172 U+0173 U+016E U+016F
W	Ŵ ŵ	U+0174 U+0175
Y	Ý ý Ÿ ý Ŷ ŷ	U+00DD U+00FD U+0178 U+00FF U+0176 U+0177
Z	Ž ž Ž ž Ž ž	U+0179 U+017A U+017D U+017E U+017B U+017C
{DELETE}	Az a-z illetve az A-Z közötti betűket kivéve a fent fel nem sorolt egyéb karaktereket el kell távolítani	

Válogatott példák

Megjegyzendő, hogy ezek a példák csak akkor érvényesek, ha a nemzeti azonosító CONCAT. A legtöbb ország esetében magasabb prioritást élvező egyéb azonosítók elvártak a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet (6. cikk (2) bekezdés) szerint.

Utónév/utónevek	Vezetéknév/ családi név/nevek	Országkód + CONCAT	Megjegyzés
John	O'Brian	IE19800113JOHN#OBRIA	"John" feltöltése 5 karakterre. O' csatolása a névhez, konvertálás nélkül. Aposztróf eltávolítva.
Ludwig	Van der Rohe	HU19810214LUDWIROHE#	"Van der" előtag eltávolítása
Victor	Vandenberg	US19730322VICTOVANDE	Az egybeírt "Van" nem minősül előtagnak
Eli	Ødegård	NO19760315ELI##ODEGA	"Eli" feltöltése 5 karakterre. Ø átírva O-ra, å átírva A-ra
Willeke	de Bruijn	LU19660416WILLEBRUIJ	"De" előtag eltávolítása
Jon Ian	Dewitt	US19650417JON##DEWIT	"Jon" feltöltése 5 karakterre. 'Ian' figyelmen kívül hagyása, csak az első utónevet használjuk. A "Dewitt" elején a "De" nem előtag.
Amy-Ally	Garção de Magalhães	PT19900517AMYALGARCA	Utónévből kötőjel eltávolítva Betűk átírva.
Giovani	dos Santos	FR19900618GIOVASANTO	Előtag eltávolítva.
Günter	Voß	DE19800715GUNTEVOS##	Az ü U-ra, az ß S-re átírva.

5.5.2 Vezeték- és utónév/nevek

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. melléklet 2. táblázatában "utónév" vagy "vezetéknév" feltüntetését igénylő mezők kitöltéséhez alkalmazzuk az 5.5.1. bekezdésben ("A CONCAT létrehozásának eljárása") ismertetett módszer 1. lépését ("A vezetéknév és utónév beszerzése"), majd a 2. lépést ("Címek eltávolítása"). Tehát az átírást nem kell alkalmazni, és az előtagokat sem kell eltávolítani. Az EU országaiban érvényes bármely karakter, akár a mellékjellel kiegészülő változat is használható. Az előtag, az utónév és a vezetéknév összes betűjét nagybetűvel írjuk.

5.6 Az ügylet fogalma

5.6.1 Szerzés és elidegenítés

Az 1. blokk bevezetésében írt magyarázat szerint az illetékes hatóságokat a piaci visszaélések miatt érdekli a pénzügyi eszközök tulajdonának változása. A tulajdonosváltással nem járó elmozdulásokat nem kell jelenteni. Nem kell jelenteni például azt, ha a diszkrecionális megbízás alapján vezetett ügyfélszámla csak végrehajtási alapú számlává alakul át.

Kivételt képez ez alól a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (4) bekezdésében konkrétan hivatkozott olyan egyidejű szerzés és elidegenítés, ahol az ügyletet utólag

közzéteszik. Ez az olyan helyzetben levő befektetési vállalkozásra vonatkozik, amely egy kereskedési helyszín ajánlati könyvében a saját ajánlatát üti le. Erre az esetre vonatkozóan a példát lásd: 5.14.3. bekezdés.

5.6.2 Kizárások a jelentésből

5.6.2.1 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének a) pontja alapján

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (5) bekezdésének a) pontja alapján az alábbi példákat érdemes tanulmányozni:

6. példa

Két befektetési vállalkozás államkötvényre köt visszavásárlási (repo) megállapodást. Az ügyletet az egyik befektetési vállalkozás az SFRT alapján jelenti be.

Ügyletjelentési kötelezettsége egyik befektetési vállalkozásnak sincs, hiszen az ügyletet bejelentése az SFRT alapján megtörtént.

7. példa

Egy kollektív befektetési vállalkozás nevében diszkrecionális megbízása alapján eljáró befektetési vállalkozás államkötvényre vonatkozó repomegállapodást köt. Tétélezzük fel, hogy az SFRT alapján az alapnak van, a befektetési vállalkozásnak nincs adatszolgáltatási kötelezettsége.

A MiFIR alapján nincs a befektetési vállalkozásnak ügyletjelentési kötelezettsége, hiszen az ügyletet bejelentése az SFRT alapján megtörtént.

5.6.2.2 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének b) pontja alapján

A transzfereken belüli teljesítési/fizetési utasítás esetében az elszámolást és/vagy kiegyenlítést végző üzleti partnerre (pl. a központi értéktárra) nem terjed ki a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (5) bekezdésének b) pontja szerinti adatszolgáltatási kötelezettség, így csak az ügyletet végrehajtó befektetési vállalkozás köteles jelentést tenni.

Hasonló a helyzet az elszámolt tőzsdén kívüli szerződés esetében, ahol nem jelentendő az eltérő elszámolt szerződésekbe történő nováció.

5.6.2.3 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének d) pontja alapján

8. példa

Egy letétkezelő/meghatalmazott úgy dönt, pénzügyi eszközöket helyez át az egyik letétkezelő bankból egy másik letétkezelő bankba.

A pénzügyi eszköz mozgása nem tartozik az ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség körébe, mert ez a tevékenység kizárólag a letétkezelői tevékenység eredményeként merült fel.

9. példa

Az egyik ügyfél letétkezelőnek/meghatalmazottnak utal át pénzügyi eszközöket, hogy azokat a letéti/megbízotti számlán vezesse.

Ez az átutalás nem tartozik az ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség körébe, mert kizárólag a letétkezelői tevékenységgel kapcsolatos.

5.6.2.4 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének e) pontja alapján

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (5) bekezdésének e) pontja szerint nem minősül ügyletnek a származtatott ügylet kereskedés utáni engedményezése vagy novációja, ha a származtatott ügylet egyik felének helyébe harmadik fél lép. Ezért nem jelentendő az, amikor elszámolás miatt határidő előtt megszűnő származékos ügyletnek megtörténik a novációja, és ezzel az eredeti szerződő felet egy harmadik fél váltja fel.

5.6.2.5 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének g) pontja alapján

A 2. cikk (5) bekezdésének g) pontja szerint nem minősül ügyletnek a *“kollektív befektetési vállalkozás befektetési jegyeinek a kollektív befektetési vállalkozás kezelője általi kibocsátása vagy visszaváltása”*.

A tőzsdén kereskedett alapok (ETF) esetében a kollektív befektetési vállalkozás befektetési jegyeinek kibocsátására vagy visszaváltására, mint folyamatra egy meghatalmazott résztvevő és a kollektív befektetési vállalkozás kezelője között kerül sor, és nem jelentendő. Ez a folyamat kiterjed arra, amikor a meghatalmazott résztvevő a kollektív befektetési vállalkozás jegyeinek átvétele ellenében átadja a kollektív befektetési vállalkozást alapjául szolgáló pénzügyi eszközt a kollektív befektetési vállalkozás kezelőjének (kibocsátás). A kizárás az ellenkező irányú folyamatra (visszaváltás) is vonatkozik. Ennek a tevékenységnek a kizárását az indokolja, hogy a piaci visszaélés kockázata minimális, mert a folyamat adminisztratív, amelyben gazdaságilag azonos értékek cserélődnek.

A befektetési vállalkozás a befektetési jegyeket a kollektív befektetési vállalkozásban, amely lehet akár ETF is, közvetlenül a kollektív befektetési vállalkozás vezetőjétől vagy kezelőjétől veszi meg a kollektív befektetési vállalkozás tájékoztatója szerint meghatározott árfolyamon. Az ügylet befektetési jegyek kibocsátásból áll, így a befektetési vállalkozás részéről nem jelentendő. Hasonlóképpen, ha az ügylet során a befektetési vállalkozás azonos feltételek mellett eladna, az a befektetési jegyek visszaváltását jelentené, és ezért nem lenne jelentendő.

Ez a kivétel kizárólag arra a kibocsátási/visszaváltási folyamatra érvényes, amely a kollektív befektetési vállalkozás kezelőjének részvételével folyik. A befektetési jegy kibocsátása után, a jegynek a másodlagos piacon (sőt a piacon kívül) történő adásvétele viszont bejelentendő függetlenül attól, hogy a megszerzés vagy az elidegenítés árfolyama megegyezik-e a nettó eszközértékkel.

10. példa

X befektetési vállalkozás (meghatalmazott résztvevő) egy kollektív befektetési vállalkozásban új befektetési jegyeket kíván szerezni a kollektív befektetési vállalkozás kezelőjétől, az ügyfeleinél a jegyek iránt jelentkező kereslet miatt.

Ha X befektetési vállalkozásnak a kibocsátási folyamat véghezviteléhez a másodlagos piacon kell beszereznie a kollektív befektetési vállalkozás alapjául szolgáló pénzügyi eszközt, akkor az ilyen alapeszköz beszerzéseket jelenteni kell, amennyiben a 26. cikk (2) bekezdése alapján az alapeszköz jelentendő.

Ha X befektetési vállalkozás ezután a kollektív befektetési vállalkozás szolgáltatójával cserét hajít végre, így az alapul szolgáló pénzügyi eszközök fejében új jegyeket kap, akkor ez nem képezi az ügyletjelentés tárgyát sem X befektetési vállalkozás, sem pedig a kollektív befektetési vállalkozás kezelője részére, mert a kibocsátási folyamat részét képezi.

5.6.2.6 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének h) pontja alapján

Amikor a pénzügyi eszközt, például opciót, fedezett opciós utalványt, átváltható vagy becserélhető kötvényt, részesedési jogot vagy jegyzési jogot a pénzügyi eszköz tulajdonosa lehívja, nem keletkezik ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége sem az opciót lehívó befektetési vállalkozásnak, sem pedig annak, amelytől az opciót lehívják²⁴. Amikor a lehívás egy másik pénzügyi eszköz leszállításával jár, szintén nem keletkezik ügyletjelentési kötelezettsége sem az opciót lehívó befektetési vállalkozásnak, sem pedig annak, amelytől az opciót lehívják.

11. példa

X befektetési vállalkozás lehív egy pénzügyi eszközt, a pénzügyi eszköz lehívásával kapcsolatosan ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége nem keletkezik.

Amikor X befektetési vállalkozás pénzügyi eszközt hív le, és készpénz helyett az alapul szolgáló pénzügyi eszközt veszi át, nem jelentendő az alapul szolgáló pénzügyi eszköz ilyen kelletlen megszerzése sem.

Nem jelentendő az sem, amikor X befektetési vállalkozás pénzügyi eszközt hív le, és választania kell a készpénz illetve az alapul szolgáló pénzügyi eszköz átvétele között.

12. példa

A pénzügyi eszköz vagy átalakítható kötvény jogosultja lehívja a pénzügyi eszközt, vagy átváltja az átalakítható kötvényt. A lehívás vagy átváltás eredményeképpen X befektetési vállalkozás (a lehívás kötelezettje) alapul szolgáló pénzügyi eszközöket szerez meg vagy idegenít el (pl. kereskedési helyszínen) annak érdekében, hogy ezeket a jogosultnak leszállíthassa.

Ügyletjelentést/jelentéseket kell benyújtani az alapul szolgáló pénzügyi eszközök megszerzésével/elidegenítésével (pl. kereskedési helyszínen történő megszerzésével) kapcsolatosan. Ugyanakkor viszont nem keletkezik ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség, amikor a jogosult átruházzák ezeket az alapul szolgáló pénzügyi eszközöket, sem pedig a pénzügyi eszköz lehívása/átalakítása folytán.

5.6.2.7 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének i) pontja alapján

A 2. cikk (5) bekezdésének i) pontjában rögzített kizárás alól kivételt jelent és jelentendő az, amikor 2. cikk (5) bekezdésének i) pontjában írt tevékenységek első nyilvános részvénykibocsátással,

²⁴ Az utóbbi egyik esete tőzsdén kereskedett származtatott termékekkel kapcsolatosan az, ahol a befektetési vállalkozás vagy annak ügyfele az engedményezési folyamat miatt lesz köteles szállítani (az alapul szolgáló pénzügyi eszközt), és az alapul szolgáló pénzügyi eszközben az ügyletet a központi szerződő fél (CCP) és/vagy annak klíringtagjai hajtják végre, hogy egy másik fél lehívási utasításait teljesítsék.

másodlagos nyilvános részvénykibocsátással vagy értékpapír-kihelyezéssel vagy hitelviszonyt megtestesítő értékpapír kibocsátásával kapcsolatosak.

2. cikk (5) bekezdésének i) pontjában rögzített kizárás kiterjed a pénzügyi eszköznek a futamidő végén vagy lejáratkor történő megszüntetésére.

Nem jelentendő az, amikor a megszerzés vagy az elidegenítés fúzióval, felvásárlással, a Tanács 1346/2000/EK rendelete szerinti fizetéseképtelenségi eljárással ²⁵, részvényfelosztással vagy részvényösszevonással kapcsolatos. Ezekben a helyzetekben a feltételeket a közgyűlésen rendszerint előre rögzítik, a vonatkozó tájékoztató hirdményeken kifüggesztik, és a befektetőre az ilyen megállapodás a befektető további döntése nélkül kiterjed.

A részvényben fizetett osztalék kibocsátása a fenti kivétel alapján nem jelentendő, hiszen a pénzügyi eszköz előre meghatározott szerződéses feltételek alapján jön létre, amellyel kapcsolatosan a befektető az eszköz létrehozásának időpontjában befektetési döntést nem hoz.

Nem jelentendő a névértéknek az amortizációs ütemterv szerinti automatikus emelkedése vagy csökkenése sem, hiszen a feltételeket már az eredeti szerződés időpontjában rögzítik, és a névérték csökkenésének/emelkedésének időpontjában döntéshozatalra nem kerül sor.

Jelentendő azonban az olyan esemény, amelynél a befektető a kibocsátás, a lejárat vagy a visszaváltás időpontjában döntés hoz. Ez utóbbiak közé tartozik az, amikor az ügyfél felvásárlási ajánlat során eldönti, hogy készpénzt vagy eszközt kér, illetve amikor a kibocsátó eldöntheti, hogy készpénzt vagy pénzügyi eszközt szállít.

13. példa

X befektetési vállalkozás egy vállalat 5 éves lejáratú kötvényeit tartja. A kibocsátás feltételei szerint a vállalat jogosult a kötvények egy részét a lejárat előtt visszaváltani. A 3. évben a vállalat visszaváltja a kibocsátott kötvény névértékének egy részét.

A kötvények visszaváltásával kapcsolatosan ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség nem keletkezik. Ennek oka az, hogy a visszaváltás a befektető (X befektetési vállalkozás) befolyásolási körén kívül eső előre meghatározott szerződéses feltételekből következik.

5.6.2.8 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének l) pontja alapján

A 2. cikk (5) bekezdésének l) pontja szerint nem minősül ügyletnek az "osztalék-újrabefektetési terv keretében végrehajtott akvizíció".

Az osztalék újrabefektetési program illetve terv (DRIP) olyan tőkebefektetési lehetőség, ahol a befektető az osztalék készpénzben történő közvetlen kifizetése helyett előre úgy dönt, hogy az osztalékot fektessék be újra a részvény alaptermékbe.

A fenti ismertetés alapján a részvény megszerzése nem jár ügyleti adatszolgáltatási kötelezettséggel.

²⁵ A TANÁCS 1346/2000/EK rendelete (2000. május 29.) a fizetéseképtelenségi eljárásról

5.6.2.9 Kizárások 2. cikk (5) bekezdés m) pontja alapján

Ez a kizárás nem vonatkozik a blokkmegbízások (ügyfelek nevében a piacon befektetés-megtakarítási terv vagy befektetés-kivonási terv keretében megvalósuló kumulált megszerzések és elidegenítések) bejelentésére, mert bár a megszerzések és elidegenítések adott terv szerint történnek, a megszerzés illetve az elidegenítés időpontjában bizonyos döntéseket meghoznak, ezért nem teljesül a kizárás összes feltétele.

14. példa

Egy társaság részvényeinek megszerzésére ajánl opciót munkavállalóinak olyan programban, ahol a megszerezhető részvények mennyisége a munkavállaló éves fizetésének 3%-ával egyenlő azzal, hogy a vétel minden negyedév utolsó napján esedékes diszkontált piaci árfolyamon, amennyiben a munkavállaló vételi szándékát legkésőbb a megelőző hónap végéig bejelentette.

A társaság X befektetési vállalkozásnak, mint levelező banknak ad megbízást arra, hogy a részvényeket a munkavállalóknak allokálja, és a társaság nevében az ellenértéket átvegye.

Az egyik munkavállaló úgy dönt, március hónapban a program alapján 350 euróért (piaci árfolyam) vásárol részvényt. Ugyanez a munkavállaló szeptemberbe 375 euróval, decemberben 400 euróval vesz részt a programban.

X befektetési vállalkozásnak semmiféle ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége nem keletkezik a március, szeptember illetve december havi ügyleteket illetően, mert egyik megszerzés összege sem haladja meg a havi 500 eurót, és egyik sem minősül a programon belül egyedi ügyletnek, noha a teljes összeg 1000 eurónál nagyobb.

5.6.2.10 Kizárások a 2. cikk (5) bekezdésének n) pontja alapján

15. példa

Egy társaság tender ajánlatot tesz kötvényeinek feláron történő visszavásárlására. Az ajánlat feltételeit korábban tájékoztató közleményben illetve tájékoztatóban megjelentek. A társaság X befektetési vállalkozásnak ad kezelői megbízást.

Sem X befektetési vállalkozásnak, sem a befektetőknek nem keletkezik ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége, mert a feltételek előzetesen megjelentek, és a befektetők másról nem, csak a tender ajánlat elfogadásáról vagy elutasításáról dönthettek.

5.7 A bejelentés mechanizmusa

Az iránymutatások I. melléklete ismerteti azt a módszert, ahogy az illetékes hatóságok a bejelentő jogalanyok jelentéseit feldolgozzák.

5.7.1 Nem alkalmazandó mezők és az eszközök referenciaadat-mezőinek kitöltése

Amikor a mezők táblázata azt jelzi, hogy egy adott mezőt a hozzá tartozó ismertetés vagy az <https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016->

[1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf](#) linken elérhető érvényesítő táblázat szerint az ott meghatározott körülmények között nem kell használni, akkor az adott mezőt nem ajánlatos kitölteni, és az ügyletjelentést el kell utasítani, amennyiben az ESMA honlapján található táblázatba foglalt érvényesítéseknek nem felel meg. Amikor például a jelentésében a vállalkozás azt jelzi, hogy a végrehajtás algoritmussal történt, az a helyes, ha a 60. mező (A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fiók országa) üresen marad.

A referenciaadatok információinak kitöltése esetében valamelyest eltérő a helyzet. A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. mellékletének 2. táblázata leszögezi, hogy a 42-től 56-ig terjedő mezőket (az eszköz referenciaadat-mezőit) nem kell használni abban az esetben, ha az ügyletet kereskedési helyszín vagy rendszeres internalizáló szerepben eljáró befektetési vállalkozás hajtja végre, vagy ahol a befektetési vállalkozás által a 41. mezőben bejelentett ISIN kódhoz tartozó referenciaadat szerepel az ESMA referenciaadatok listáján. Amennyiben a fentiek közül valamelyik feltétel teljesül, a befektetési vállalkozásnak nem szükséges ezeket a mezőket kitöltenie. Emellett az ESMA szerint minden olyan ügylet teljesíti a 2. táblázatban meghatározott feltételeket, amelyet egy adott kereskedési napon olyan eszközben hajtottak végre, amelyben a befektetési vállalkozás maga is legalább egy ügyletet végrehajtott ugyanazon a kereskedési napon egy kereskedési helyszínen vagy rendszeres internalizáló szerepben eljáró befektetési vállalkozással, ezért az adott eszköz referenciaadat-mezőit az adott ügylet esetében nem kell kitölteni.

16. példa

X befektetési vállalkozás egy kereskedési helyszínen megveszi Y eszközt, majd ugyanazon a napon tőzsdén kívül egy másik befektetési vállalkozásnak vagy vállalkozásnak eladja azt. Y eszköz nem szerepel az ESMA referenciaadat listáján²⁶. A vételre kereskedési helyszínen került sor, ezért aztán a vételi ügylet bejelentésében az eszköz referenciaadat-mezőit nem kell kitölteni. Az eladási ügylet nem felel meg közvetlenül a feltételeknek, mert nem kereskedési helyszínen jött létre, mivel azonban a vételi ügylet ugyanazon a napon kereskedési helyszínen realizálódott, az eladási ügylet bejelentésében az eszköz referenciaadat-mezőket sem kell kitölteni.

Amikor ezek a feltételek nem teljesülnek, a befektetési vállalkozással szemben elvárás, hogy töltsse ki a 42-től 56-ig terjedő mezők közül azokat, amelyek az eszköz esetében relevánsak.

Ugyanakkor helytelen lenne, ha az illetékes hatóság ügyletjelentéseket azért utasítana vissza, mert a befektetési vállalkozás kitöltötte a referenciaadat-mezőket, holott az ügylet kereskedési helyszínen realizálódott, vagy szerepel az ESMA listán.

5.7.2 Ügyletjelentések benyújtása

A MiFIR 26. cikk (7) bekezdése szerint a befektetési vállalkozás egy adott kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek piaci oldalának bejelentését illetően a kereskedési helyszínre hagyatkozhat. A magát jóváhagyott jelentési mechanizmusként (ARM) regisztráló kereskedési helyszín szolgáltatásként felkínálhatja, hogy bejelenti az olyan ügyletek ügyfél oldali információit is, amelyeket nem az ő rendszerén keresztül hajtottak végre.

²⁶ Abban a valószínűtlen esetben, amikor a kereskedési helyszín az eszköz referenciaadatokat nem küldi meg az ESMA részére.

Amikor a kereskedési helyszín egy befektetési vállalkozás nevében nyújt be jelentéseket az a helyes, ha azokat ahhoz az illetékes hatósághoz juttatja el, amelyhez a befektetési vállalkozásnak kell azokat benyújtania függetlenül attól, hol található a kereskedési helyszín központja.

Amikor a kereskedési helyszín olyan ügyletekről nyújt be jelentést, amelyeket a vállalkozás a MiFIR 26. cikk (5) bekezdése alapján hajt végre, akkor az elvárás az, hogy a jelentést a hazai illetékes hatósághoz nyújtsa be.

5.7.2.1 Az ügyletjelentések benyújtásának határideje

5.7.2.1.1 Az adatszolgáltatás időzítése

Az ügyleteknek a befektetési vállalkozások hazai illetékes hatóságához²⁷ legkésőbb az adott hatóság helyi időszámítása szerint az ügylet napját követő első munkanapon 23:59:59 másodpercig be kell érkeznie (tehát a T napon végrehajtott ügyletről az adatokat legkésőbb T+1 napon 23:59:59 másodpercig be kell jelenteni). A befektetési vállalkozás a T napon végrehajtott ügyleteinek adatait ugyanazon a napon (tehát T napon) is bejelentheti függetlenül attól, hogy jelentéseit közvetlenül vagy a nevében eljáró ARM közbenjárásával, illetve azon a kereskedési helyszínen keresztül teszi, amelynek a rendszerén az ügyletek teljesültek. Ez azt jelenti, hogy a vállalkozásoknak megfelelő időben be kell nyújtaniuk az információt a kereskedési helyszínhez vagy a jóváhagyott jelentési mechanizmushoz, hogy azok a jelentést az illetékes hatósághoz a T+1 napos határidőn belül be tudják nyújtani.

5.7.2.1.2 Munkanap

Munkanap a szombat és a vasárnap valamint a jelentésre jogosult nemzeti illetékes hatóság tagállamában a nemzeti ünnepek kivételével a hét minden napja.

II. rész - Blokkok

5.8 1. blokk: Eladó/Vevő azonosítása

Az illetékes hatóságot inkább a piaci visszaélések miatt, mintsem a jogcím tulajdonosának megállapítása céljából érdekli, hogy ki áll ügyfélként az ügylet mögött. Ezért amikor olyan mozgás történik, amely az ügyfél tulajdonának megváltozását vonja maga után, az a helyes, ha a bejelentésben az esetleg jogcímmel rendelkező letéteményes/megbízott helyett inkább az ügyfél jelenik meg értelemszerűen, mint vevő/eladó. Ugyanakkor az olyan átruházást kivéve, amely a 4. cikkben az átruházásra vonatkozóan rögzített, és az 5.26.3 bekezdésben tárgyalt feltételeket teljesíti, a befektetési vállalkozásnak a közvetlen ügyfelét kell bejelentenie. A befektetési vállalkozással szemben nem elvárás, hogy a saját ügyfelén vagy üzleti partnerén túl tekintve igyekezzen megállapítani, ki a végső ügyfél. Amikor például a befektetési vállalkozásnak nincsenek meg az ügylet mögött álló ügyfél/ügyfelek adatai, akkor nem kell végigböngésznie a vagyonkezelőtől kezdve a vagyonkezelő mögötti ügyfelet/ügyfeleket, hanem csak a vagyonkezelőt kell vevőként/eladóként (a LEI-kóddal azonosítva) bejelentenie. Ahol azonban a befektetési vállalkozás ismeri az ügyfelet és olyan vagyonkezelői konstrukciót alakít ki, mint az önálló befektetésen alapuló személyes nyugdíjnál, akkor bejelentésben inkább az ügyfelet és nem a vagyonkezelőt kell eladóként/vevőként feltüntetni.

²⁷ Illetve a kereskedési helyszín hazai illetékes hatóságához, amennyiben a kereskedési helyszín nem befektetési vállalkozásnak minősülő tagja nevében közöl adatot.

Érdemes megjegyezni, hogy az 5.8.1-5.10.1 bekezdésekben alább ismertetett üzleti esetek a vevők azonosítását és kiegészítő adatait mutatják, de ugyanez a megközelítés érvényes az eladókra is.

5.8.1 A LEI-kódra jogosult vevő/eladó

Ez az alábbi körülmények között érvényes:

Vevő/Eladó a piacon üzleti partnerként fellépő vállalkozás vagy befektetési vállalkozás;

Vevő/Eladó központi szerződő fél (akkor érvényes, amikor az ügylet kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben központi szerződő féllel jön létre);

Vevő/Eladó rendszeres internalizálóként fellépő befektetési vállalkozás;

Vevő/Eladó LEI-kódra jogosult ügyfél (a felek azonosítását lásd az I. részben, az 5.5 bekezdésben).

17. példa

X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre A ügyfél számára, aki megvásárolja a pénzügyi eszközt.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
9	Vevő utónevei		<Buyr>
10	Vevő vezetéknevei		<AcctOwnr>
11	Vevő – születési dátum		<Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx>

5.8.2 Vevő/Eladó természetes személy

5.8.2.1 Vevő/Eladó EGK állampolgár (egy állampolgársággal)

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 6. cikke alapján a jelentésben a természetes személyt az állampolgárságát jelző ISO 3166-1 alfa-2 országgóddal kell azonosítani, amelyet az adott SZTS II. mellékletében felsorolt, az adott személy állampolgárságán alapuló azonosító követ. Továbbá a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 7. cikke alapján, amennyiben az ügyfél természetes személy, akkor az ügyletjelentésben szerepelnie kell az ügyfél teljes nevének és születési idejének.

18. példa

X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre 2. ügyfél számára, aki megvásárolja a pénzügyi eszközt.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
7	A vevő azonosító kódja	Jose Luis Rodriguez de la Torre {NATIONAL_ID}-ja	<Tx> <New> ...
9	Vevő utónevei	"JOSE,LUIS"	<Buyr>
10	Vevő vezetéknévei	"RODRIGUEZ,DE LA TORRE"	<AcctOwnc> <Id>
11	Vevő – születési dátum	1976.02.27.	<Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ, DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> ...
			</New> </Tx>

A használandó azonosítót az adott személy állampolgársága határozza meg, és nem a lakóhelye vagy a vállalkozás helye.

Mivel a befektető spanyol állampolgár, az azonosító az adószám (Código de identificación fiscal) a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet II. sz. mellékletének megfelelően. A "NIDN" rendszernév a nemzeti ügyfélazonosító használatára utal. A "CCPT" érték az útlevélszám használatára utalna, míg az állampolgárság, a születési idő és a rövidített név összevonását a "CONCAT" rendszernév jelzi. A bekezdés után bemutatott két példa mind a három megoldást szemlélteti.

5.8.2.2 Vevő/Eladó nem-EGK állampolgár (egy állampolgársággal)

19. példa

X befektetési vállalkozás saját számlára pénzügyi eszközt ad el egy ügyfélnek.

Az ügyfél amerikai állampolgár, Paul O'Connor, aki Portugáliában él. Születési ideje 1941. március 4.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet II. sz. mellékletében írtak szerint Paul O'Connor azonosítására az USA útlevelét helyes használni az ügyletjelentésben, mert az ügyletjelentés szempontjából az állampolgárság és nem az adott személy lakóhelye határozza meg, hogy melyik azonosítót használjuk.

Paul O'Connor USA útlevélszáma 123456789ZZ.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
7	A vevő azonosító kódja	Paul O'Connor {NATIONAL_ID}-ja	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PAUL</FrstNm> <Nm>O'CONNOR</Nm> <BirthDt>1941-03-04</BirthDt> <Othr> <Id>US123456789ZZ</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Vevő utónevei	"PAUL"	
10	Vevő vezetékevei	"O'CONNOR"	
11	Vevő – születési dátum	1941.03.04.	

Ha Paul O'Connornak nincs USA útlevélszáma, akkor a 7. mezőben a létrehozott összefűzött szám, tehát US19410304PAUL#OCONN szerepeljen.

5.8.2.3 Vevőnek/Eladónak kettős állampolgársága van (két EGK országban)

20. példa

X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre egy ügyfél nevében.

A pénzügyi eszközt vásárló ügyfél, Anne-Marie Berg svéd és francia állampolgársággal rendelkezik, születési ideje 1963. december 3.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 6. cikk (3) bekezdésében rögzített követelmények alapján Franciaország (FR) ISO 3166 szerinti alfabétája az ábécében előbb áll, mint Svédorszáé (SE). Ezért a Franciaország által első helyen megadott számot, azaz a CONCAT-kódot kell használni (lásd: 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet II. sz. melléklet), és nem a svéd személyi igazolvány számát. A CONCAT szám ez lesz: FR19631203ANNEMBERG#.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
7	A vevő azonosító kódja	Anne-Marie Berg {NATIONAL_ID}-ja	<pre> <TxRpt> <Tx> <New> ... </pre>
9	Vevő utónevei	"ANNE-MARIE"	
10	Vevő vezetékevei	"BERG"	

11	Vevő – születési dátum	1963.12.03.	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>ANNE-MARIE</FrstNm> <Nm>BERG</Nm> <BirthDt>1963-12-03</BirthDt> <Othr> <Id>FR19631203ANNEMBERG#</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
----	------------------------	-------------	---

5.8.2.4 Vevőnek/Eladónak kettős állampolgársága van (egy EGK és egy nem-EGK országban)

21. példa

X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre egyik ügyféle, David Ștefan számára, aki megvásárolja a pénzügyi eszközt. Az ügyfélnek osztrák és román állampolgársága van, születési ideje 1952. május 8.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 6. cikk (3) bekezdése szerint az EGK állampolgárság elsőbbséget kap, ezért a román nemzeti személyi igazolvány számot (Cod Numeric Personal) helyes használni.

David Ștefan román nemzeti személyi igazolványának száma 1234567890123.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
7	A vevő azonosító kódja	David Ștefan {NATIONAL_ID}-ja	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>DAVID</FrstNm> <Nm>ȘTEFAN</Nm> <BirthDt>1952-05-08</BirthDt> <Othr> <Id>RO1234567890123</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </pre>
9	Vevő utónevei	"DAVID"	
10	Vevő vezetéknévei	"ȘTEFAN"	
11	Vevő – születési dátum	1952.05.08.	

			<pre> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Ha a fenti példában a személy nem rendelkezik román nemzeti személyi igazolványszámmal, akkor a román útlevelének számát kell használni. Ha útlevele sincs, akkor a CONCAT-kód használata a helyes. Esetében a CONCAT-kód ez lesz: RO19520508DAVIDSTEFA.

5.9 2. blokk: Az Eladó/Vevő nevében döntést hozó személy

Az üzleti életből vett alábbi esetek azt mutatják be, hogyan tanácsos a vevő nevében döntést hozó személyt azonosítani, de ugyanez vonatkozik az eladó nevében döntő személyre is.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet. I. sz. mellékletének 2. táblázatában meghatározottak szerint a vételi döntéshozó mezőit (12–15. mezők) csak akkor kell használni, ha az ügyfél a vevő, és a befektetési döntést képviseleti jog alapján hozzák meg. A képviseleti jog egy vagy több, az ügyfélen kívüli harmadik félre utal, aki felhatalmazást kapott arra, hogy az ügyfél nevében befektetési döntéseket hozzon. Előfordulhat, hogy ennek az egy vagy több harmadik félnek nincs kapcsolata a végrehajtó befektetési vállalkozással, de lehet a végrehajtó befektetési vállalkozás maga. A képviseleti jogot természetes vagy jogi személy ügyfél és olyan személy telepíthet, aki meghatalmazás alapján az ügyfél nevében természetes vagy jogi személyként eljárhat.

Amennyiben ez a harmadik fél a befektetési vállalkozás, a 12. mezőben a befektetési vállalkozásnak és ne befektetési vállalkozás által foglalkoztatott egyedi döntéshozónak az azonosítója álljon (az egyedi döntéshozóra az 57. mező vonatkozik).

Ez az alábbi körülmények között fordul elő:

amikor a képviseleti joggal rendelkező személy utasítást ad a befektetési vállalkozásnak (ide értve a meghatalmazási konstrukciót); vagy

a vevő diszkrecionális megbízást ad a végrehajtó befektetési vállalkozásnak.

Abban az esetben, ha az eladó/vevő több személynek adott képviseleti jogot, a döntéshozót jelölő mezőbe az az egy vagy több személy kerüljön, aki a befektetési vállalkozásnak az utasítást adta.

Minden egyéb esetben az a feltételezés, hogy a döntéshozó és a vevő azonos, és ezekben az esetekben a döntéshozóval kapcsolatos mezők (12–15. mező) üresen maradnak. Ez arra az esetre is kiterjed, ahol meghatalmazás van érvényben, de a konkrét ügyletre vonatkozóan a döntést nem a meghatalmazott, hanem maga a vevő hozta.

Az ajánlás és a tanács nem minősül befektetési döntésnek, ezért ahol csak ajánlásra vagy tanácsadásra kerül sor, ott maradjon a döntéshozóval kapcsolatos mező üresen.

Az alapok és az alapkezelők konkrét esetében a megbízását végrehajtó befektetési vállalkozás az alap kezelőjét azonosítsa vevőként/eladóként, és hagyja a döntéshozóra vonatkozó mezőket üresen, ha a

2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeket kielégítő továbbítás nem történt (lásd 5.27.1. bekezdés).

5.9.1 A döntéshozó a Vevő/Eladó

22. példa

X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre A ügyfél számára, aki megvásárolja a pénzügyi eszközt. A vételről a döntést A ügyfél hozza.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Vevő utónevei		
10	Vevő vezetéknevei		
11	Vevő – születési dátum		
12	Vételi döntéshozó kódja		
13	Vételi döntéshozó – valamennyi utónév		
14	Vételi döntéshozó – valamennyi vezetéknev		
15	Vételi döntéshozó – születési dátum		

Mivel a befektetési döntést a vevő hozza, a döntéshozóra vonatkozó mezők üresek.

5.9.2 A döntéshozó olyan harmadik fél, aki a Vevőtől/Eladótól képviseleti jogot kapott.

5.9.2.1 A döntéshozó meghatalmazással rendelkező fél.

23. példa

X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre egyik ügyféle, Sean Murphy számára, aki megvásárolja a pénzügyi eszközt.

Sean Murphy ír állampolgár, születési ideje 1976. február 27. A számlája feletti rendelkezésre meghatalmazást adott ügyvédjének, Thomas MacCormacknak, aki szintén ír állampolgár és 1951. december 12-én született. A megbízást MacCormack úr adta.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
---	------	---------	--------------------

7	A vevő azonosító kódja	Sean Murphy {NATIONAL_ID}-ja	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>SEAN</FrstNm> <Nm>MURPY</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>IE19760227SEAN#MURPH</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>THOMAS</FrstNm> <Nm>MACCORMACK</Nm> <BirthDt>1951-12-12</BirthDt> <Othr> <Id>IE19511212THOMAMACCO</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Vevő utónevei	"SEAN"	
10	Vevő vezetéknevei	"MURPHY"	
11	Vevő – születési dátum	1976.02.27.	
12	Vételi döntéshozó kódja	Thomas MacCormack {NATIONAL_ID}-ja	
13	Vételi döntéshozó – valamennyi utónév	"THOMAS"	
14	Vételi döntéshozó – valamennyi vezetéknev	"MACCORMACK"	
15	Vételi döntéshozó – születési dátum	1951.12.12.	

Mivel Sean Murphy és Thomas MacCormack mindketten ír állampolgárok, az összefűzött kódot használjuk, mert ezt adta meg Írország első helyen. A kódok a következők: IE19760227SEAN#MURPH illetve IE19511212THOMAMACCO.

5.9.2.2 A döntéshozó az Eladó/Vevő nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozás.

24. példa

X befektetési vállalkozás diszkrecionális megbízás alapján ügyletet hajt végre egy ügyfél nevében. Ezért a befektetési döntés az ügyfél helyett X befektetési vállalkozás hozza. Az ügyfél, Pepe Torres Blanco mexikói állampolgár, útlevélszáma MMM23654Z, születési ideje 1968. május 20.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
---	------	---------	--------------------

7	A vevő azonosító kódja	Pepe Torres Blanco {NATIONAL_ID}-ja	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PEPE</FrstNm> <Nm>TORRES, BLANCO</Nm> <BirthDt>1968-05-20</BirthDt> <Othr> <Id>MXMMM23654Z</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Vevő utónevei	"PEPE"	
10	Vevő vezetéknevei	"TORRES", "BLANCO"	
11	Vevő – születési dátum	1968.05.20.	
12	Vételi döntéshozó kódja	X befektetési vállalkozás jogalany- azonosító {LEI} kódja	
13	Vételi döntéshozó – valamennyi utónév		
14	Vételi döntéshozó – valamennyi vezetéknev		
15	Vételi döntéshozó – születési dátum		

5.10 3. blokk: (Az 1. és a 2. blokk együtt) Eladó/vevőre és döntéshozóra vonatkozó forgatókönyvek

Akárcsak a fenti blokkoknál, az alább ismertetett üzleti eset a vevők azonosítását és kiegészítő adatait mutatja, de ugyanez a megközelítés érvényes az eladókra is.

5.10.1 Vevőnek/Eladónak közös számlája van

25. példa

X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre egy közös számláról, amelynek a tulajdonosa a férj Pierre DuPont és felesége Marie DuPont. Pierre DuPont francia állampolgár, 1976. február 27-én született. Felesége, Marie állampolgársága szerint lengyel, születési ideje 1977. január 17., nemzeti személyi igazolványának (PESEL) száma 1234567890. A befektetési döntést a közös számla képviselőjére jogosult Charles Owen hozza, aki 1968. október 11-én született. Owen dél-afrikai állampolgár (útleve száma: 1111222233334).

A pénzügyi eszközt a közös számla veszi meg.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a vevő adatait?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
---	------	---------	--------------------

7	A vevő azonosító kódja	Pierre DuPont {NATIONAL_ID}-ja Marie DuPont {NATIONAL_ID}-ja	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PIERRE</FrstNm> <Nm>DUPONT</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>FR19760227PIERRDUPON</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>MARIE</FrstNm> <Nm>DUPONT</Nm> <BirthDt>1977-01-17</BirthDt> <Othr> <Id>PL12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>CHARLES</FrstNm> <Nm>OWEN</Nm> <BirthDt>1968-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ZA1111222233334</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx>
9	Vevő utónevei	"PIERRE" "MARIE"	
10	Vevő vezetéknevei	"DUPONT" "DUPONT"	
11	Vevő – születési dátum	'1976.02.27.' '1977.01.17.'	
12	Vételi döntéshozó kódja	Charles Owen {NATIONAL_ID}-ja	
13	Vételi döntéshozó – valamennyi utónév	'CHARLES'	
14	Vételi döntéshozó – valamennyi vezetéknev	'OWEN'	
15	Vételi döntéshozó – születési dátum	1968.10.11.	

A 7-től 11-ig terjedő mezőket mindegyik vevő esetében meg kell ismételni.

A döntéshozó a közös számla és nem az egyes magánszemélyek nevében jár el, ezért csak egyszer kell kitölteni.

5.10.2 Az eladó elhalálozott

Elhalálozott ügyféllel vagy örökséggel kapcsolatos hagyatéki végzéséből származó ügyletek esetén az elhunytat jelölik meg eladóként, és az elhunyt tekintendő a döntéshozónak is, ezért a döntéshozóra vonatkozó mezők maradjanak üresen. Amikor egy adott fél pénzügyi eszközt örököl, a jelentésben vevőként szerepeljen, és az örökös tekintendő a döntéshozónak is, ezért a döntéshozóra vonatkozó mezők maradjanak üresen.

5.11 4. blokk: A vállalkozáson belüli befektetési döntés mező

5.11.1 A vállalkozáson belüli befektetési döntés

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 8. cikk (1) bekezdése szerint ez a mezőt minden olyan esetben ki kell tölteni, amikor a befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, mert könyveit kockázatnak teszi ki, és úgy tekintendő, mint aki befektetési döntést hoz. Ez alól az egyetlen kivétel az olyan szállítás körében merül fel, ahol a befektetési vállalkozás az adatokat átvevő befektetési vállalkozásként szolgáltatja, és saját számlára kereskedik, ezért akkor jár el helyesen, ha ekkor az 57. mező szerint a szállító befektetési vállalkozástól kapott információval tölti ki a jelentés ügyfél oldali részét (lásd: 5.26.3.1., 5.26.4.1., 5.26.4.2 és 5.27.2. bekezdés).

Továbbá, a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 8. cikk (1) bekezdése szerint ebben a mezőben akkor is szerepeljen adat, amikor a diszkrecionális megbízás alapján az ügyfél nevében eljáró befektetési vállalkozás befektetési döntést hoz (5.27.1).

26. példa

X befektetési vállalkozás pénzügyi eszközt vesz.

A befektetési vállalkozásnál a befektetési döntésért 1. sz. kereskedő felelős elsősorban.

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás a vállalkozás mezőben a befektetési döntést?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	1. kereskedő {NATIONAL_ID}- ja	<pre> <Tx> <New> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Érdemes megjegyezni, hogy a vevő adataitól eltérően a befektetési vállalkozásnál a befektetési döntésért felelős konkrét személy adatait nem kötelező megadni. Egyetlen adatot kötelező szerepeltetni, az adott személy nemzeti azonosítóját.

Ahol a befektetési vállalkozásnál elsősorban egy algoritmus hozza a befektetési döntéseket, az 57. mezőben az algoritmus kódja szerepeljen.

5.11.2 A befektetési vállalkozáson kívül hozott befektetési döntések (a befektetési döntést az ügyfél hozza, a befektetési vállalkozás pedig saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez vagy "egyéb szerepben" jár el)

27. példa

X befektetési vállalkozás saját kitétség nélkül ügyletpárosítás révén vagy "egyéb szerepben" eljárva pénzügyi eszközt vásárol olyan ügyfélnek, akinek a nevében kizárólag végrehajtást végez, vagy tanácsadói alapon jár el.

Itt az kell vélelmezni, hogy a befektetési döntést az ügyfél hozza függetlenül attól, hogy X befektetési vállalkozás ajánlotta-e az ügyfélnek a pénzügyi eszközt, hiszen végső soron az ügyfél az, aki a befektetésről dönt.

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás a vállalkozás mezőben a befektetési döntést?

Ha X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" jár el, vagy saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez, sem az 57., sem a 12. mezőt nem kell kitöltenie.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		<pre> <Tx> <New> ... <FinInstrm> ... </FinInstrm> <ExctgPrsn> ... </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre> <p><i>Ha a mezőben nem szerepel adat, a vonatkozó XML elem (tehát a <InvstmtDcsnPrsn>) maradjon ki az üzenetből.</i></p>

Ha a fentiekől eltérően X befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, még akkor is azt kell vélelmezni, hogy a befektetési döntést X befektetési vállalkozás hozta, ha az ügyletet az ügyfél kezdeményezte, és ezért az a helyes, ha 57. mezőben szerepel adat, a 12. mező pedig üresen marad.

5.12 5. blokk: Végrehajtás a vállalkozáson belül mező

Az a helyes, ha az 59. mező kitöltése mindegyik ügyletjelentés esetében megtörténik. Abban az esetben, amikor a végrehajtásról a döntést az ügyfél (például az ügyfél utasításában szerepelnek az

ügylet adatai, így a végrehajtás helyszíne is) vagy a befektetési vállalkozáson kívüli egyéb személy (például azonos csoporthoz tartozó társaság munkavállalója) hozza, akkor a befektetési vállalkozás ebben a mezőben a 'NORE' értéket szerepeltesse.

28. példa

X befektetési vállalkozás ügyfél nevében vesz pénzügyi eszközt, és az ügylet adatai az ügyfél utasításában szerepelnek.

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás a vállalkozás mezőben a befektetési döntést?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	'NORE'	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

Ha a mezőbe nem a 'NORE', hanem bármilyen egyéb kód kerül, akkor az (a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 9. cikkében meghatározottak szerint) a befektetési vállalkozáson belüli személy vagy algoritmus azonosítója legyen attól függően, hogy melyikük felel elsősorban a végrehajtásért. A befektetési vállalkozás feladata, hogy ezt a saját irányítási modellje alapján eldöntse.

5.12.1 A végrehajtásért az elsődleges felelősség a személyt terheli

Abban az esetben, amikor a végrehajtásért az elsődleges felelősség a személyt terheli, az 59. mezőben az adott személy nemzeti azonosítója álljon.

5.12.2 A végrehajtásért az elsődleges felelősség az algoritmust terheli

29. példa

Ha a végrehajtást algoritmus bonyolította, a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletének 2. táblázatában az 59. mezőben az algoritmust kell bejelenteni.

X befektetési vállalkozás pénzügyi eszközt vesz, és az ügylet végrehajtása a befektetési vállalkozás algoritmusának (kód: 4567EFZ) a feladata

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás a vállalkozás mezőben a befektetési döntést?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	{Az algoritmus kódja}	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <Algo>4567EFZ</Algo> </ExctgPrsn> </New> </Tx> </pre>

			</ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
--	--	--	--

Az "algorithmus" kifejezésen minden olyan rendszer értendő, amely emberi beavatkozás nélkül automatikusan hajt végre ügyleteket. Ebben az esetben az a helyes, ha az automata rendszer azonosítója is szerepel a táblázatban.

5.13 6. blokk: Kereskedés dátuma és időpontja

A kereskedés bejelentendő dátuma és időpontja az ügylet felmerülésének és a felek ügyleti kötelezettsége keletkezésének időpontja, és nem az az időpont, amikor az ügyletet később visszaigazolják.

Amikor egy befektetési vállalkozás egy nem EGK vállalkozásnak megbízást ad, és az a megbízást teljesíti, a befektetési vállalkozásnak arra kell törekednie, hogy a lehető legpontosabb dátumot és időt kapja meg.

A kereskedés dátumát és időpontját tartalmazó 28. mezőben az értékek ne legyenek kerekítve, és a pontosság szintje feleljen meg a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. táblázatában a 28. mezőben rögzített követelményeknek.

Az ügyletjelentések pontosságára vonatkozó követelményeket lásd az időbélyegző pontosságával foglalkozó 7.2. bekezdésben.

5.14 7. blokk: Helyszín

Ebben a blokkban a példák a helyszín mező és a közvetlen piaci ügyletekkel kapcsolatos egyéb mezők kitöltésére vonatkoznak. Érdemes megjegyezni, hogy a "Helyszín mező bejelentése láncok esetén" nevet viselő 5.4.2. mezőben adott magyarázat szerint az a helyes, ha csak a kereskedési helyszín²⁸, a kereskedési platform vagy a rendszeres internalizáló közvetlen végrehajtását azonosítjuk a helyszínen történt végrehajtásként. A helyszín mező egyéb helyzetekben való kitöltésének példáit az 5.22-től 5.24-ig és az 5.26-5.27 közötti bekezdésekben (ahol a többszörös végrehajtás forgatókönyveiről, a megbízások csoportosításáról, a saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végző szervezett kereskedési rendszerről és a befektetési vállalkozások láncolatában történő végrehajtásról, a szállításról és a diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozásról olvashat).

IV. rész mutatja be, hogy konkrét pénzügyi eszközökben létrejött ügyleteket hogyan tanácsos bejelenteni.

5.14.1 Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben

30. példa

²⁸ Ide tartoznak azok az esetek is, ahol a kereskedési helyszínen kívül megállapodott ügyletekre a kereskedési helyszín szabályai lesznek érvényesek.

X befektetési vállalkozás pénzügyi eszközt ad el egy kereskedési helyszínen. Az ügylet végrehajtása 2018. május 5-én 09:10:33.124373 időpontban történt. A kereskedési helyszínen létrehozta a kereskedési helyszíni ügyletazonosító kódját (TVTIC) (ABCDEFG123456).

a) M kereskedési helyszíni (amely központi szerződő felet használ)

b) B kereskedési helyszíni nem használ központi szerződő felet, és a végrehajtás időpontjában nem nevezték meg a szerző/elidegenítő fél azonosítóját. A MIC szegmensazonosító kódja 'XABC'.

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás a helyszíni mezőben a befektetési döntést?

N	Mező	a). értékközlés	b) értékközlés
3	A kereskedési helyszíni ügyletazonosító kódja	'ABCDEFG123456'	'ABCDEFG123456'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínihez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B kereskedési helyszíni szegmensazonosító {MIC} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-05-05T09:10:33.124Z'	'2018-05-05T09:10:33.124Z'
36	Helyszíni	M. kereskedési helyszíni szegmensazonosító {MIC} kódja	B kereskedési helyszíni szegmensazonosító {MIC} kódja

XML-beli ábrázolás:

a) jelentés	b) jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... <TradPlcMtchglId>ABCDEFG123456</TradPlcMtchglId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <MIC>XABC</MIC> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> ... <TradVn>XABC</TradVn> ... <TradPlcMtchglId>ABCDEFG123456</TradPlcMtchglId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

	</Tx>
--	-------

5.14.2 Ügylet végrehajtása EU-n kívüli kereskedési platformon nem anonim ajánlati könyvben

31. példa

X befektetési vállalkozás Y befektetési vállalkozás vételi ajánlatának leütésével jelentendő pénzügyi eszközt ad el egy EU-n kívüli szervezett kereskedési platformon (MIC: XAAA). A tranzakció végrehajtásának időpontja 2018. szeptember 10. 13:15:45.122469.

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás a helyszín mezőben és a kapcsolódó mezőkben a befektetési döntést?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja		<Tx> <New> ...
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ...
7	A vevő azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-10T13:15:45Z'	...
36	Helyszín	A kereskedési platform szegmensazonosító {MIC} kódja	<Tx> <TradDt>2018-09-10T13:15:45Z</TradDt> ... <TradVn>XAAA</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja ebben az esetben nem alkalmazandó, mert az ügyletet nem kereskedési helyszínen hajtották végre.

X befektetési vállalkozás ismeri a piaci üzleti partnert (Y befektetési vállalkozás), és ezért a piaci üzleti partnert, jelen esetben vevőként azonosítja az ügyletjelentés.

Mivel az ügylet nem kereskedési helyszínen jön létre, az időpont pontosságának másodpercnél vagy annál jobbnak illik lennie.

5.14.3 Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben szereplő saját ajánlat leütésével

Az I. rész 5.6. bekezdésében az 'Ügylet fogalma' alatt már említésre került, hogy ez az a helyzet, amelyre a 2. cikk (4) bekezdésének rendelkezése a jogalkotó szándéka szerint vonatkozik.

32. példa

X befektetési vállalkozás saját számlájára kereskedve M kereskedési helyszínen saját ajánlatát üti le, ami és ezáltal létrejön egy kereskedési helyszín ügyletazonosító kód (TVTIC) (ABCDEFGH123456) a 2018. július 15-én 11:37:22.867415 időpontban végrehajtott ügyletről.

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás a helyszín mezőben és a kapcsolódó mezőkben a befektetési döntést?

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'ABCDEFGH123456'	'ABCDEFGH123456'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-15T11:37:22.867Z'	'2018-07-15T11:37:22.867Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>

<pre> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.867Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XABC</TradVn> ... <TradPlcMtchgId>ABCDEFG123456</TradPlcM tchgId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.867Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XABC</TradVn> ... <TradPlcMtchgId>ABCDEFG123456</TradPlcM tchgId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

5.14.4 Ügyletet végrehajtó rendszeres internalizáló

33. példa

Y befektetési vállalkozás részvényeket kíván eladni. A rendszeres internalizálóként fellépő X befektetési vállalkozás megveszi a részvényeket Y befektetési vállalkozástól. Az ügylet időpontja 2018. július 15-én 11:37:22.Z.

Az SI MIC szakasza SMIC

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés	
		X befektetési vállalkozás	Y befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja		
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja

16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-15T11:37:22.Z'	'2018-07-15T11:37:22.Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
36	Helyszín	Rendszeres internalizáló szegmensazonosító {MIC} kódja (X befektetési vállalkozás)	Rendszeres internalizáló szegmensazonosító {MIC} kódja (X befektetési vállalkozás)

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN<LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN<LEI> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN<LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

5.15 8. blokk: Short ügylet jelölése

Az alább ismertetett üzleti esetek olyan körülményekre vonatkoznak, ahol a befektetési vállalkozás a 236/2012/EU rendelet 12., 13. és 17. cikkének hatálya alá tartozó jelentendő részvényt vagy állampapírt

ad el rövidre²⁹ saját számláról vagy ügyfél nevében. A befektetési vállalkozás kérdezze meg ügyfelét, hogy short ügyletet hajt-e végre számára.

Ha az ügyfél a short ügyletről nem ad tájékoztatást a befektetési vállalkozásnak, akkor a 62. mezőben az 'UNDI' (nincs tájékoztatás) érték álljon.

A short ügylet megjelölése inkább az egyedi ügyfelekkel létrejött, mint az összesített piaci ügyletek bejelentésére vonatkozik. Ezért olyan esetben, amikor mindkét vagy az egyik ügyfél rövidre ad el, akkor a short ügylet megjelölés az összesített piaci ügyletjelentésben maradjon üresen, mert ez a jelentés nem egyedi ügyfélre, hanem minden olyan ügyfélre vonatkozik, akinek a megbízását a jelentés összesíti.

Lásd még az 5.23., 5.24. és 5.27.2. bekezdést arról, hogyan alkalmazzuk a short ügylet megjelölést olyan esetekben, ahol összesítésre kerül sor.

15.5.1 A befektetési vállalkozás ügyfele rövidre ad el (X vállalkozásnak erről tudomása van)

34. példa

X befektetési vállalkozás A ügyfél nevében részvényeket ad el. A ügyfél rövidre ad el.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a short ügyletre vonatkozó információt?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
16	Az eladó azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id>
18	Eladó – utóneve(i)		</AcctOwnr>
19	Eladó – vezetékeve(i)		</Sellr>
20	Eladó – születési dátum		...
62	Short ügylet megjelölése	'SESH'	<AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

15.5.2 X befektetési vállalkozás saját számlán rövidre ad el

35. példa

²⁹ A 2346/2012/EU rendelet 2. cikke (1) bekezdésének b) pontja szerint.

X befektetési vállalkozás saját számlán rövidre ad el állampapírt

15.5.2.1 Az ügyletre mentesség alapján kerül sor

Az ügyletre az árjegyzői tevékenységeknek illetve az elsődleges piaci műveleteknek a 236/2012/EU rendelet 17. cikke alapján fennálló mentessége alapján kerül sor.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a short ügyletre vonatkozó információt?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr>
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	</Sellr>
62	Short ügylet megjelölése	'SSEX'	</Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SSEX</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> ... </New> </Tx>

15.5.2.2 Az ügyletre nem mentesség alapján kerül sor

Az ügyletre nem az árjegyzői tevékenységeknek illetve az elsődleges piaci műveleteknek a 236/2012/EU rendelet 17. cikke alapján fennálló mentessége alapján kerül sor.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás a short ügyletre vonatkozó információt?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás	> ...

		jogalany- azonosító {LEI} kódja	
62	Short ügylet megjelölése	'SESH'	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>

5.16 9. blokk: Mentesség, OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó, valamint az árualapú származtatott termékek megjelölése

5.16.1 Mentesség és OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés

A 61. mezőt az a befektetési vállalkozás töltse ki, amely az ajánlatot a kereskedési helyszínrre beadta, illetve az ügyletet a kereskedési helyszínrnek jelentette.

A befektetési vállalkozás a 63. mezőben az OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelöléséhez ne adja meg a 'CANC' értéket, mert a 26. cikk (3) bekezdése, amely az OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés kötelezettségét előírja, a MiFIR 26. cikke szerinti, a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikkében meghatározott ügylet létét feltételezi, márpedig a 'törlés' nem minősül a MiFIR 26. cikke szerinti ügyletnek.

5.16.1.1 Kereskedési helyszínrn végrehajtott ügylet

36. példa

X befektetési vállalkozás saját számlán hajt végre ügyletet egy ügyfél számára. Az eszköz részvény instrumentum. X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínrn veszi meg a pénzügyi eszközt, majd eladja azt az ügyfélnek.

A kereskedési helyszínrn a vétel végrehajtására a „referenciaár” MiFIR 4. cikke szerinti mentessége alapján kerül sor. Az ügyfél részére történő eladás a MiFIR 20. cikk (3) bekezdés a) pontja szerint a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó méretű („Large in scale”).

Mivel az ügylet piaci oldalának végrehajtása kereskedési helyszínrn történik, az a helyes, ha X befektetési vállalkozás jelentésében szerepel a mentesség jelzése. X befektetési vállalkozás jelentésében kell szerepelnie az ügylet ügyfél oldalára vonatkozóan az OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölésének is.

Hogyan szerepeltesse X befektetési vállalkozás a jelentésében a mentesség és az OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölését?

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'
61	Mentesség megjelölése	'RFPT'	
63	OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés		'LRGS'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés (piaci oldali jelentése)	2. jelentés (ügyfél oldali jelentése)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <WvrlInd>RFPT</WvrlInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>

5.16.1.2 OTC (over the counter) ügyletek

37. példa

X befektetési vállalkozás Y befektetési vállalkozással OTC ügyletet hajt végre egy tőkeinstrumentumban. X és Y befektetési vállalkozás egyaránt saját számlára kereskedik. Az ügylet nagyságrendje a szokásosnál nagyobbabbnak minősül.

Mivel az ügylet végrehajtására OTC piacon kerül sor, csak az OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés vonatkozik rá.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	Értékközlés Y befektetési vállalkozás
---	------	--	--

4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'
61	Mentesség megjelölése		
63	OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés	'LRGS'	'LRGS'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> ... <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> ... <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>

5.16.1.3 Az ügylet nem az ajánlati könyvben, de a kereskedési helyszín szabályai szerint teljesül

38. példa

X befektetési vállalkozás A ügyfél nevében eljárva hajt végre ügyletet, melynek során Y befektetési vállalkozástól tőkeinstrumentumot vesz. Az ügylet nem az ajánlati könyvben, de M kereskedési helyszín szabályai szerint jön létre. Az ügylet végrehajtása a MiFIR 4. cikk (1) bekezdés b) pontjának ii. alpontja szerint a "nem likvid pénzügyi eszközökben létrejött előre letárgyalt ügyletekre" vonatkozó mentesség alapján történik.

Y befektetési vállalkozás a kereskedési helyszín tagja, és az ügyletet a kereskedési helyszínnek be is jelentette, amely az ügyletet utólag az átláthatóság érdekében közzétette.

Y befektetési vállalkozás és A ügyfél saját számlára kereskedik.

A mentesség megjelölését ügyletjelentésében Y befektetési vállalkozás szerepeltesse, hiszen az ügyletet a kereskedési helyszínek ő jelentette be, ugyanezt X befektetési vállalkozás is megteheti, ha van információja.

Mivel X és Y között az ügylet a kereskedési helyszín szabályai szerint jött létre, az OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölést nem kell kitölteniük a jelentéseikben, mert az csak olyan ügyletekre vonatkozik, amelyek nem kereskedési helyszínen teljesülnek.

A ügyfél ne szerepeltesse jelentésében a mentesség megjelölését, mert nem ő jelenti be a kereskedési helyszínen az ügylet piaci oldalát. Az OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölést A ügyfél semmiképpen ne töltsse ki, mert itt nem különálló OTCügyletről, hanem az ügyletnek a piaci végrehajtáshoz kapcsolódó ügyfél oldali lábáról, azaz egy láncolat adott részéről van szó.

Hogyan jelentsen X és Y befektetési vállalkozás, illetve A ügyfél feltéve, hogy A ügyfél befektetési vállalkozás?

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	Értékközlés Y befektetési vállalkozás	Értékközlés Y befektetési vállalkozás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'DEAL'	'DEAL'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'
61	Mentesség megjelölése		'OILQ'	
63	OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés			

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése	A ügyfél jelentése
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN OP QRST</ExctgPty></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</ExctgPty></pre>

<pre> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA AAAAA</LEI> </Id> ... </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</L EI> </Id> ... </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPS T</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <Wvrlnd>OILQ</Wvrlnd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA AAAAA</LEI> </Id> ... </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>123456789012345678 90</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</Tradg Cpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	---	--

5.16.2 Kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés jelzése olyan esetben, ahol a befektetési vállalkozás két ügyfél ajánlatait OTC piaconpárosítja

Lásd: 5.20. bekezdés.

5.16.3 Árualapú származtatott termék megjelölése

5.16.3.1 Ahol az ügyfél jelzi, hogy kockázatot csökkent

39. példa

X befektetési vállalkozás 3. ügyfél nevében eljárva a MiFIR 2. cikk (1) bekezdés 30. albekezdése szerinti árualapú származtatott termékben hajtott végre ügyletet, amelyről 3. ügyfél jelezte, hogy azzal

kockázatát a 2014/65/EU irányelv 57. cikkének megfelelően objektíven mérhető módon csökkenti. X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" jár el.

Hogyan szerepeltesse X befektetési vállalkozás az árualapú származtatott termék megjelölését a jelentésében?

29	Kereskedési szerep	‘AOTC’	<Tx> <New>
64	Árualapú származtatott termék megjelölése	‘true’ (igaz)	<pre> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>

Ha 3. ügyfél nem jelezte X befektetési vállalkozásnak, hogy kockázatát a 2014/65/EU irányelv 57. cikkének megfelelően objektíven mérhető módon csökkenti, akkor X befektetési vállalkozás a 64. mezőben a 'false' (hamis) értéket szerepeltesse.

5.16.3.2 Ahol az instrumentum nem árualapú származtatott termék

40. példa

X befektetési vállalkozás 3. ügyfél nevében eljárva olyan instrumentumban hatott végre ügyletet, amely a MiFIR 2. cikk (1) bekezdés 30. albekezdése szerinti nem árualapú származtatott termék.

Hogyan szerepeltesse X befektetési vállalkozás az árualapú származtatott termék megjelölését a jelentésében?

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	
29	Kereskedési szerep	‘AOTC’	

64	Árualapú származtatott termék megjelölése		<pre> <Tx> <New> ... <Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
----	---	--	--

Mivel az instrumentum a MiFIR 2. cikk (1) bekezdés 30. albekezdése szerinti nem minősül árualapú származtatott terméknek, a 64. mezőt nem kell alkalmazni, így üresen marad.

5.17 10. blokk: Fióktelepek

5.17.1 Ügyfél nevében végrehajtott ügylet

41. példa

A holland befektetési vállalkozás (D befektetési vállalkozás) jogalany-azonosítója 13579135790246802468. Fióktelepet Párizsban (FR), Londonban (GB) és Frankfurtban (DE) működtet. Egy spanyol ügyféltől (E ügyfél) megbízást kap 7. sz. kereskedőjén keresztül egy bizonyos pénzügyi eszköz megvételére. E ügyfél jogalany-azonosítója 242424242424242424. Az ügyfél a megbízást a párizsi fióktelepnek küldi meg. A párizsi fióktelep a londoni értékpapír osztálynak továbbítja a megbízást. A londoni fióktelep által felügyelt 8. sz. kereskedő úgy dönt, M kereskedési helyszínen hajtja végre az ügyletet. 7. sz. kereskedő francia állampolgár, neve Jean Bernard, aki 1972. május 4-én született. A 8. sz. kereskedő az Egyesült Királyság állampolgára, nemzeti biztosítási száma QQ123456C. M kereskedési helyszínen a frankfurti fióktelepnek van tagsága³⁰.

Az ügyletjelentést a (holland) AFM-nek nyújtják be.

Hogyan töltsé ki D vállalkozás és E ügyfél a fióktelepre vonatkozó mezőket, amennyiben E ügyfélnek ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége van és saját számlára kereskedik?

N	Mező	Értékközlés D befektetési vállalkozás	Értékközlés E ügyfél
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	D vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	E ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	E ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	E ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
8	A fióktelep helye szerinti ország a vevő esetében	'FR'	

³⁰ Egyes joghatóságokban van mód arra, hogy a (helyi) fióktelep legyen a piac tagja, sőt egyes esetekben ez a szokásos eljárás.

16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	D vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
17	A fióktelep helye szerinti ország az eladó esetében		
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'DEAL'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'
37	Tagsággal rendelkező fióktelep országa	'DE'	
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		7. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország		ES
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	8. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	7. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'GB'	'ES'

XML-beli ábrázolás:

D befektetési vállalkozás jelentése	E ügyfél jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>13579135790246802468</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>242424242424242424</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>24242424242424242424</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>242424242424242424</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>13579135790246802468</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> </pre>

<pre> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>QQ123456C </Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

A 17. mezőt nem tölti ki sem D befektetési vállalkozás, sem E ügyfél, mert ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha az eladó mezőben a végrehajtó befektetési vállalkozás ügyfele szerepel. Hasonló a helyzet a 8. mezőnél is, amelyet E ügyfél ügyletjelentésében szintén nem kell kitölteni, mert E ügyfélnél a 7. mezőben nem szerepel mögöttes ügyfél.

D. befektetési vállalkozás jelentésében az 57. mező marad üresen, mert D. befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" jár el. Üresen marad D. befektetési vállalkozás jelentésében az 58. mező is, hiszen az 57. mezőben sem áll adat.

Az ügyfél az 58. mezőben E ügyfél központjának országkódját (ES) szerepelteti, hiszen fióktelep nem vett részt az ügyletben.

5.17.2 Saját számlára végrehajtott ügylet

42. példa

7. sz. kereskedő egy adott pénzügyi eszköz eladásáról dönt, a kereskedő felügyeletét E spanyol befektetési vállalkozás látja el, melynek jogalany-azonosítója 12312312312312312, és Párizsban (FR), Londonban (GB) és Frankfurtban (DE) működtet fióktelepet. 7. sz. kereskedő úgy dönt, a megbízást M kereskedési helyszínen hajtja végre, ahol a frankfurti fióktelep tag.

Az ügyletjelentést a (spanyol) CNMV-nek nyújtják be.

Hogyan töltsse ki E befektetési vállalkozás a fióktelepre vonatkozó mezőket?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	E befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> ... </pre>

7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12312312312312312312</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
8	A fióktelep helye szerinti ország a vevő esetében		<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12312312312312312312</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>
16	Az eladó azonosító kódja	E befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> ... </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
17	A fióktelep helye szerinti ország az eladó esetében		
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	
37	Tagsággal rendelkező fióktelep országa	'DE'	
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	7. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország	'ES'	
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	7. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'ES'	

A 17. mező üresen marad, mert csak akkor kell kitölteni, ha az eladó mezőben ügyfél szerepel.

5.17.3 Nem EGK-beli vállalkozások EGK-beli fióktelepe által végrehajtott ügylet

43. példa

Egy kereskedő egy adott pénzügyi eszköz vételéről dönt, a kereskedő felügyeletét F amerikai befektetési vállalkozás látja el, melynek jogalany-azonosítója 22222222222222222222, és Párizsban (FR), Londonban (GB) és Frankfurtban (DE) működtet fióktelepet. A kereskedő az ügyletet M kereskedési helyszínen hajtja végre. M kereskedési helyszínen a frankfurti fióktelepnek van tagsága. A vállalkozás saját számlára kereskedik.

Hogyan töltsse ki F vállalkozás a fióktelepre vonatkozó mezőket?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	F vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
7	A vevő azonosító kódja	F vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>22222222222222222222</ExctgPty> ...
8	A fióktelep helye szerinti ország a vevő esetében		<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>22222222222222222222</LEI> </Id> </AcctOwnr>
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>
17	A fióktelep helye szerinti ország az eladó esetében		</Sellr>
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	</Sellr>
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ...
37	Tagsággal rendelkező fióktelep országa	'DE'	<TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </Tx>
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország	'US'	... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch>
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'US'	... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </ExctgPrsn> ...

			</New> </Tx>
--	--	--	-----------------

A 8. és 17. mezők (a vevő és az eladó fióktelepének helye szerinti ország) üresen maradnak, mert ezeket a mezőket csak akkor kell kitölteni, ha a vevő vagy az eladó mezőben szerepel az ügyfél.

Az ügyletjelentéshez előzetesen el kell dönteni, hogy azt melyik illetékes hatóságnak fogják benyújtani. Ennek az illetékes hatóságnak nem kell azonosnak lennie azzal, amely az ügyletben részt vevő fióktelepeket engedélyezte, de azok közül helyes kiválasztani, amely a vállalkozás valamelyik fióktelepének engedélyét a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 14. cikkében a harmadik országbeli vállalkozás közös választásáról írtak szerint kiadta. A fenti példában tehát az ügyletjelentést a brit, a francia vagy a német illetékes hatóságnak lehet benyújtani.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerint amikor egy nem EGK-beli vállalkozás EGK-beli fióktelepe a 3. cikkben rögzített tevékenységet folytatja, akkor végrehajtást végez és ezért köteles az ügyleteit jelenteni. Ebben az esetben a végrehajtó a német fióktelep, hiszen ő kereskedik a piacon, és ezért F vállalkozás ügyletjelentését a fentiek szerint kell kitölteni.

5.18 11. blokk: Az ügyletjelentések státusza és javítása

Az 1. mezőben a 'NEWT' értéket a még bejelentetlen ügyletek esetében és akkor adjuk meg, amikor az eredeti ügyletjelentés törlése után a hibás ügyletjelentést javítjuk.

A 'CANC' státuszt a nem jelentendő ügyletek ügyletjelentésének törlése esetén, illetve akkor adjuk meg, amikor a hibás ügyletjelentést töröljük, mielőtt helyette a javított jelentést benyújtjuk.

A végrehajtó befektetési vállalkozás által benyújtott ügyletjelentésekben az ügylet hivatkozási száma (TRN) mindig legyen egyedi. Amikor adott esetben több jóváhagyott jelentési mechanizmus is részt vesz, az ügylet hivatkozási számát mindig a végrehajtó befektetési vállalkozás szintjén helyes megképezni. Ugyanazt az ügylet hivatkozási számot nem tanácsos ismételt felhasználni, kivéve azt az esetet, amikor egy eredeti ügyletjelentést javítunk vagy törölünk, ekkor ugyanis ugyanazt az ügylet hivatkozási számot érdemes használni az eredeti jelentést helyettesítő jelentésben is (lásd: 5.18.3. és 5.18.4. bekezdés). Az a helyes, ha egy-egy ügylet hivatkozási számát ugyanannak az ügyletjelentésnek a javításaiban ismételt felhasználjuk. Előfordulhat, hogy ugyanahhoz az ügyletkeghez egynél több (új vagy törölt) rekord tartozik (és ezekben azonos az ügylet hivatkozási száma és a végrehajtó jogalany azonosító kódja), ezeket érdemes egy fájlban elhelyezni. Ilyen esetben a fájlban elhelyezett rekordok sorrendje kövesse a feldolgozásuk logikáját, tehát i. törölni csak olyan ügyletet lehet, amelynek a bejelentése korábban már új ügyletként megtörtént, és nem lett törölve, és ii. amennyiben adott ügyletnek a korábbi jelentése törlésre került, az adott ügyletet csak ugyanazokkal az azonosítókkal (ügylet hivatkozási száma és a végrehajtó jogalany azonosító kódja) lehet benyújtani. Konkrétan a következő eseteket kell figyelembe venni:

- új ügyletet jelentünk be, majd azonnal töröljük (mind a két jelentést ugyanabban a fájlban nyújtjuk be) -> az új ügylet jelentése a fájlban előzze meg a törlést tartalmazó jelentést;
- egy korábbi fájlban bejelentett ügylet törlésre kerül, és ezzel azonos időben ugyanennek az ügyletnek egy újabb változatát jelentjük be (az előző jelentés törlését és az új változatot ugyanabban a fájlban nyújtjuk be) -> a korábbi ügylet törlése a fájlban előzze meg az új ügyletjelentést (az ügylet új változatát);

- c) a fenti körülmények kombinációi (azaz egy ügyletnek egynél több új vagy törlő rekord tartozik) -> a körülményektől függően (fenti a) vagy b) pont) a fájlban elhelyezett első rekord az új vagy a törlő rekord legyen, az utána következő rekordok sorrendjét helyes úgy kialakítani, hogy minden rekordot egy ellentétes típusú rekord kövessen.

5.18.1 Törlés és módosítás adott napon belül

Amikor egy befektetési vállalkozás az ügyletet utólagosan közzéteszi, majd a közzétételt még az ügyletjelentés benyújtása előtt törli, nem szükséges az ügyletről jelentést benyújtania.

Amikor egy befektetési vállalkozás az ügyletet utólagosan közzéteszi, majd a közzétételt még az ügyletjelentés benyújtása előtt módosítja, az ügyletjelentésnek csak az ügylet legutolsó utólagos közzétételben szereplő információt kell tükröznie.

5.18.2 Új ügyletjelentés benyújtása

44. példa

X befektetési vállalkozás 2018. március 10-én 12:45:30-kor OTC ügyletet hajt végre. Az ügyletjelentést egy jóváhagyott jelentési mechanizmuson, az ARM 1-en (jogalany-azonosítója ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1) keresztül nyújtja be. Az ügylet hivatkozási száma ETYRU9753.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékek Eredeti jelentés	XML-beli ábrázolás
1	A jelentés státusza	'NEWT'	<Tx>
2	Az ügylet referenciaszáma	'ETYRU9753'	<New> <TxId>ETYRU9753</TxId>
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	ARM 1 jogalany-azonosító {LEI} kódja	ARM1</SubmitgPty> ... <Tx>
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-03-10T12:45:30Z'	<TradDt>2018-03-10T12:45:30Z</TradDt> </Tx> ... </New> </Tx>

Érdemes megjegyezni, hogy az 1. mező nem XML elemként szerepel az üzenetben. Helyette a New vagy a Cxl címke használatos.

5.18.3 Törlés benyújtása

45. példa

X befektetési vállalkozás új ügyletjelentést nyújt be (részleteket lásd az 5.18.2. bekezdésben) ARM 1-en keresztül (jogalany-azonosítója: ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1), majd később törli az ügyletjelentést.

Érdemes megjegyezni, hogy az eredeti jelentést nemcsak az a jogalany törölheti, amelyik azt eredetileg benyújtotta, hanem egy másik benyújtó jogalany is. Tegyük fel például, hogy a befektetési vállalkozás az eredeti jelentést egy jóváhagyott jelentési mechanizmuson keresztül nyújtotta be, ekkor a jelentést saját maga törölhet vagy egy másik jóváhagyott jelentési mechanizmust is igénybe vehet.

Törlés esetében csak az alapvető mezőket, azaz az 1., 2., 4. és 6. mezőt szükséges kitölteni. A vállalkozás a teljes jelentést nem adhatja be ismét. Elutasításra kerül az olyan ismételt benyújtott ügyletjelentés, amely az alapvető mezőkön kívül egyéb mezőket is tartalmaz.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Eredeti jelentés értékei	Törlő jelentésének értékei
1	A jelentés státusza	'NEW'	'CANC'
2	Az ügylet referenciaszáma	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	ARM 1 jogalany-azonosító {LEI} kódja	ARM 1 jogalany-azonosító {LEI} kódja

XML-beli ábrázolás:

Eredeti jelentés	Törlés jelentése
<pre><Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1 </SubmitgPty> ... </New> </Tx></pre> <p>Érdemes megjegyezni, hogy az 1. mező nem XML elemként szerepel az üzenetben. Helyette a New vagy a Cxl címke használatos.</p>	<pre><Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </Cxl> </Tx></pre> <p>Érdemes megjegyezni, hogy az 1. mező nem XML elemként szerepel az üzenetben. Helyette a New vagy a Cxl címke használatos.</p>

5.18.4 Ügyletjelentés információinak helyesbítése

Ahhoz, hogy egy ügyletjelentésben bizonyos információkat helyesbíteni lehessen, előbb törölni kell az eredeti jelentést, és egy újat kell benyújtani.

Törlés esetében csak az alapvető mezőket, azaz az 1., 2., 4. és 6. mezőt szükséges kitölteni. Visszautasításra kerül az olyan törlő ügyletjelentés, amely a fenti négy mezőn kívül egyéb mezőket is tartalmaz.

A helyettesítő jelentésben viszont szerepeltetni kell a bejelentett tranzakcióra vonatkozó összes mezőt.

46. példa

X befektetési vállalkozás az 5.18.2. bekezdésben 5 GBP árfolyamon ügyletet hajtott végre, de az ügylet árfolyamát apró és nem fő pénznemegységben (font helyett penny-ben) jelentette.

Az ügyletjelentést a következő napon 14:50:20-kor törli, és egyben egy helyettesítő jelentést is benyújt, amelyben az árfolyam helyesen szerepel.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Eredeti jelentés értékei	Törlő jelentés értékei	Helyettesítő jelentés értékei
1	A jelentés státusza	'NEWT'	'CANC'	'NEWT'
2	Az ügylet referenciaszáma	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	ARM 1 jogalany-azonosító {LEI} kódja	ARM 1 jogalany-azonosító {LEI} kódja	ARM 1 jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-03-10T12:45:30Z'		'2018-03-10T12:45:30Z'
33	Árfolyam	'500'		'5'

XML-beli ábrázolás:

Eredeti jelentés	Törlő jelentés	Helyettesítő jelentés
<pre><Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM 1ARM1ARM1</SubmitgPty> ... <Tx> <TradDt>2018-03- 10T12:45:30Z</TradDt> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">500</Amt></pre>	<pre><Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM 1ARM1ARM1</SubmitgPty> </Cxl> </Tx></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>1234567890123 4567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1A RM1ARM1ARM1</Submitg Pty> ... <Tx> <TradDt>2018-03- 10T12:45:30Z</TradDt> ... <Pric> <Pric> <MntryVal></pre>

<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>		<pre> <Amt Ccy="GBP">5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	--

Megjegyzendő, hogy a dátum és az időpont '2018-03-10T12:45:30Z', ami az eredeti ügylet és nem a helyesbítő jelentés dátumával és időpontjával azonos. Érdeemes azt is megjegyezni, és ez az iránymutatásokra nézve általában is igaz, hogy az eredeti és a helyettesítő jelentésnek az ügyletre vonatkozóan az összes egyéb adatot is tartalmaznia kell, és a fenti példák a jelentéseket kivonatolva mutatják be.

5.19 12. blokk: Névleges érték változása

5.19.1 Névleges érték növekedése

47. példa

X befektetési vállalkozás egy hitel-nemteljesítési csereügylet keretében 2 millió euró értékben kockázatot vesz át Y befektetési vállalkozástól 2018. október 26-án 08:21:01 időpontban. A hitel-nemteljesítési csereügyletben 100 bázispontos a fix kamatszelvény, X befektetési vállalkozás előzetes fizetés fejében 50 000 eurót kap. X és Y befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	Értékközlés Y befektetési vállalkozás
2	Az ügylet referenciaszáma	'12456771'	'39998776'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-10-26T08:21:01Z'	'2018-10-26T08:21:01Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'2000000'	'2000000'
32	Származtatott termék névleges értékének növekedése/csökkenése		
33	Árfolyam	'100'	'100'
38	Előleg	'50000'	'50000'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> <TxId>12456771</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> </AcctOwnc> </Buyr> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN<LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-26T08:21:01Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">2000000</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">50000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>39998776</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN<LEI> </ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> </AcctOwnc> </Sellr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10- 26T08:21:01Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">2000000</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">50000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

Megjegyzendő, hogy az előzetes fizetés (38. mező) értékének mind az X, mind a kockázatot átadó Y befektetési vállalkozás ügyletjelentésében pozitívnak kell lennie, hiszen az összeget a hitel-nemteltjesítési csereügylet eladója kapja.

A fenti CDS ügyletben résztvevő felek 2018. november 25-én 10:52:03 időpontban megállapodnak abban, hogy a névleges értéket 5 millió euróra emelik, és az X befektetési vállalkozásnak kiegészítésként járó fizetés 75 000 euróban állapítják meg. A kamatszervény szerinti fizetés változatlan marad.

Hogyan jelentse be X és Y befektetési vállalkozás a névleges érték emelkedését?

N	Mező	Értékközlés	
		X befektetési vállalkozás	Y befektetési vállalkozás
2	Az ügylet referenciaszáma	'124567981'	'399987981'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-11-25T10:52:03Z'	'2018-11-25T10:52:03Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'3000000'	'3000000'
32	Származtatott termék névleges értékének növekedése/csökkenése	'INCR'	'INCR'
33	Árfolyam	'100'	'100'
38	Előleg	'75000'	'75000'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> <TxId>124567981</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>399987981</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>

<pre> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">3000000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>INCR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">75000</Amt> </UpFrntPmt> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Tx> <TradDt>2018-11- 25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">3000000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>INCR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">75000</Amt> </UpFrntPmt> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	---

Ebben az ügyletjelentésben az ügylet hivatkozási száma (2. mező) az emelkedésre vonatkozóan egyedi, és nem azonos az eredeti ügyletjelentésben szereplő hivatkozási számmal.

A mennyiség (30. mező) a névleges érték növekményének összege. Azokban az esetekben, amikor a kamatkifizetések a névleges érték változása után szintén változnak, az árfolyam mezőben (33. mező) az új kamatot kell szerepeltetni.

Figyelmet érdemel, hogy a dátum és az időpont az emelés és nem az eredeti ügylet dátuma és időpontja.

Az eredeti ügyletjelentés törlésére nincs szükség.

Az eredeti ügyletnek valamint a névleges érték emelésének bejelentése együtt jelzi, hogy X befektetési vállalkozás üzleti partnerétől 5 millió euró értékben kockázatot vett át.

5.19.2 Névleges érték csökkenése

5.19.2.1 Lejárat előtti részleges megszűnés

48. példa

A fenti példával azonos helyzetben a felek 2018. november 25-én 10:52:03 időpontban nem a névleges érték megemeléséről, hanem arról állapotodnak meg, hogy azt 0,5 millió euróval 1,5 millió euróra csökkentik, és a csökkentés fejében X befektetési vállalkozás 37 500 eurót fizet.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	X befektetési vállalkozás értékközlése	Értékközlés Y befektetési vállalkozás
2	Az ügylet referenciaszáma	'124567852'	'39998792'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-11-25T10:52:03Z'	'2018-11-25T10:52:03Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'500000'	'500000'
32	Származtatott termék névleges értékének növekedése/csökkenése	'DECR'	'DECR'
33	Árfolyam	'100'	'100'
38	Előleg	'37500'	'37500'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> <TxId>124567852</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">500000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>DECR</DerivNtnlChng> <Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>39998792</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11- 25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">500000</MntryVal> </Qty> </pre>

<pre> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <DerivNtnlChng>DECR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	--

Az előzetes fizetés mindkét jelentésben pozitív értéket mutat, hiszen bár ebben az esetben X befektetési vállalkozás nem kapja, hanem fizeti az összeget, ebben a jelentésben az eladó Y, és a fizetett összeget eladó kapja.

Mivel a kitétség csökken, és eredetileg a kockázatot X befektetési vállalkozás vette át, most X befektetési vállalkozás átadja a kockázatot.

A mennyiség (30. mező) a névleges érték csökkenésének összege. Azokban az esetekben, amikor a kamatfizetések a névleges érték változása után szintén változnak, az árfolyam mezőben (33. mező) az új kamatot kell szerepeltetni.

Figyelmet érdemel, hogy a dátum és az időpont a csökkenés és nem az eredeti ügylet dátuma és időpontja.

Az eredeti ügyletnek valamint a névleges érték csökkenésének bejelentése együtt jelzi, hogy X befektetési vállalkozás üzleti partnerétől 1,5 millió euró értékben vett át kockázatot. Az eredeti ügyletjelentés törlésére nincs szükség.

5.19.3 Lejárat előtti teljes megszűnés

Ha a felek a szerződés lejárat előtti teljes megszűnéséről állapodnak meg, akkor a névleges érték az eredeti szerződésben szereplő teljes összeggel kell csökkenteni.

III. rész – Kereskedési forgatókönyvek

5.20 Értékpapírok átvezetése

5.20.1 Átvezetés azonos vállalkozás ügyfelei között

Az I. részben már felhívtuk a figyelmet arra, hogy amennyiben a mögöttes ügyfél tulajdonjoga nem változik, akkor nincs szükség ügyletjelentésre. Ez a szabály vonatkozik arra az esetre, amikor az átvezetés adott befektetési vállalkozáson belül történik, és arra is, amikor két különböző befektetési

vállalkozás között vagy egy befektetési vállalkozás és egy vállalkozás között valósul meg, de a tulajdonos egy és ugyanaz marad.

Ha a befektetési vállalkozás úgy végez átvezetést számlák között, hogy abból ügylet keletkezik, akkor azt kell vélelmezni, hogy a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 3. cikke szerinti ügyletet hajtott végre. Ha azonban a befektetési vállalkozás kizárólag az ügyvitelt támogató minőségében vesz részt, és az átvezetést nem saját maga bonyolítja le, akkor nem vélelmezhető róla, hogy ügyletet hajtott végre.

Jelentendő az ügyfél számlájáról az olyan közös számlára történő átvezetés, amelynek az egyik tulajdonosa maga az ügyfél. Hasonlóképpen jelentendő az is, amikor egy közös számla alakul át egyetlen számlatulajdonos számlájává.

Ez az elv vonatkozik a közös portfólióból a kizárólagos tulajdonú portfólióba történő átvezetésre, a kezelt alapból a kedvezményezetteknek történő kifizetésekre, a szülői számláról a kiskorú számára nagykorúvá válásakor történő átvezetésre, a magánszemély tulajdonában álló társaság nevére az adott magánszemély által történő átvezetésekre (forgalmazásokra), jótékonyági célra történő, az aukcióból származó illetve az olyan átvezetésekre, ahol az eladót a vevővel a befektetési vállalkozás párosítja.

Az elhunyt ügyfél hagyatéki végzése vagy örökség, aukció illetve ajándék kezeléséből adódó mozgásokkal kapcsolatos átvezetések jelentendők, mert az ilyen ügylet annak ellenére szerzéssel és elidegenítéssel, tehát tulajdonosváltással jár együtt, hogy nincs ár, és ide tartozik az is, amikor egy értékpapírszámla tulajdona egyik kedvezményezetttről egy másikra száll át.

Az árfolyam mezőben a megfizetett ár szerepeljen még akkor is, ha az a piaci árfolyamtól eltér. Amikor pénzügyi eszközök átadására kerül sor, de azokért árat nem fizetnek (pl. ajándék vagy alapok/portfóliók közötti átvezetés), akkor az árfolyam mezőben a 'NOAP' érték szerepeljen.

49. példa

A ügyfél olyan eszközöket kíván átvezetni B ügyfél számlájára, amelyek fejében fizetést nem kap. Díjfizetés nem történik. A két számlát ugyanaz a befektetési vállalkozás (X vállalkozás) vezeti, amely az átvezetést végrehajtja.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás ezt az átvezetést?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty
7	A vevő azonosító kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	> ... <Buyr> <AcctOwnr>

16	Az eladó azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> —Figyelem! Ha az ár nem értelmezhető, a NOAP kódot használjuk. </pre>
33	Árfolyam	'NOAP'	

Azt a dátumot és időpontot kell bejelenteni, amikor X befektetési vállalkozás az átvezetést végrehajtotta.

5.20.2 Átvezetések két különálló befektetési vállalkozás ügyfelei között

50. példa

A. ügyfél 100 db pénzügyi eszközt kíván X befektetési vállalkozásnál vezetett számlájáról B ügyfélnek egy másik, Y befektetési vállalkozásnál vezetett számlájára átvezetni. A ügyfél utasítását X befektetési vállalkozáshoz nyújtja be, amely azt 2018.10.05-én 09:53:17-kor végre is hajtja. Sem X, sem Y befektetési vállalkozás nem ismeri a másik ügyfelét.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	Értékközlés Y befektetési vállalkozás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI}

			kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-10-05T09:53:17Z'	'2018-10-05T09:53:17Z'
30	Mennyiség	'100'	'100'
33	Árfolyam	'NOAP'	'NOAP'
34	Az árfolyam pénzneme		

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre> <p>Note: NOAP code should be used when price is not applicable.</p>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre> <p>Note: NOAP code should be used when price is not applicable.</p>

X és Y befektetési vállalkozás egyaránt bejelenti az átvezetés végrehajtásának időpontját, amelyek eltérhetnek egymástól. A 28. mezőben álló dátum és az időpont nem a megbízás átadásának dátumát és időpontját mutatja, hanem az ügyletét.

5.20.3 Két ügyfél megbízásait OTC piacon párosító vállalkozások

51. példa

X befektetési vállalkozás tőzsdén kívül hajt végre ügyletet A ügyfél, mint vevő és B ügyfél, mint eladó között. Egyik ügyletet sem terheli ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség. Az ügyletet annak létrejötte után közzé kell tenni, azért az OTC ügylet utólagos közzétételének jelzését 'ACTX' (ügynökségi keresztyügle) értékre kell állítani.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> >
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Buyr> <AcctOwnc> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr>
36	Helyszín	'XOFF'	<AcctOwnc> <Id>
63	OTC ügylet utólagos jelzése	'ACTX'	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> <TradVnc>XOFF</TradVnc> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

52. példa

X befektetési vállalkozás tőzsdén kívül hajt végre ügyletet A ügyfél, mint vevő és B ügyfél, mint eladó között. B ügyletet befektetési vállalkozásként ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség terheli. B ügyfélnek nincs mögöttes ügyfele.

X és B befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	Értékközlés B befektetési vállalkozás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	B befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	B befektetési vállalkozás I jogalany-azonosító {LEI} kódja	B befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'DEAL'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'
63	OTC ügylet utólagos jelzése	'ACTX'	

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </pre>

<pre> ... </Tx> <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

Ha A ügyfél olyan befektetési vállalkozás lenne, amelyre kiterjed az ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség, akkor ügyletjelentésében X befektetési vállalkozást, mint eladót kellene azonosítania.

5.21 Közvetítő befektetési vállalkozás ügyletjelentése

5.21.1 Két ügyfél megbízásait közvetítőbefektetési vállalkozás

53. példa

X befektetési vállalkozás saját számlára kíván adott eszközt eladni.

Y befektetési vállalkozás saját számlára kívánja ugyanazt az eszközt megvenni.

X és Y vállalkozást Z befektetési vállalkozás hozza össze, de saját maga nem vesz részt az ügyletben.

X és Y befektetési vállalkozás saját maguk állapotodnak meg az ügylet részleteiben.

Z befektetési vállalkozásnak semmiféle adatszolgáltatási kötelezettsége nincs, bejelentést X és Y vállalkozás tesz.

X befektetési vállalkozásnak a végrehajtás időpontjában tudomása van arról, hogy Y az üzleti partnere.

Y befektetési vállalkozásnak a végrehajtás időpontjában tudomása van arról, hogy X az üzleti partnere.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés	
		X befektetési vállalkozás	Y befektetési vállalkozás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
-------------------------------------	-------------------------------------

<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

5.21.2 Befektetési vállalkozás közbeékelődés nélkül egy másik befektetési vállalkozásnak mutatja be ügyfelét

54. példa

A ügyfél egy adott eszközt kíván megvenni. Brókere, X vállalkozás ilyen eszközzel nem kereskedik, ezért bemutatja A ügyfelet Y befektetési vállalkozásnak.

Y befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínen megveszi A ügyfél számára a pénzügyi eszközöket. Y befektetési vállalkozásnak a végrehajtás pillanatában tudomása van arról, hogy A ügyfél az ő ügyfele, és A ügyfél is tudja, hogy az adott ügylet szempontjából Y befektetési vállalkozással áll kapcsolatban. X befektetési vállalkozásnak nincs szerepe a végrehajtásban, és X befektetési vállalkozástól csupán jutalékot kap a bemutatásért.

Mivel X befektetési vállalkozás nem hajtott végre semmit, ügyletjelentést nem nyújt be.

Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> ... </pre>

7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty>
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </New> </Tx> </pre>

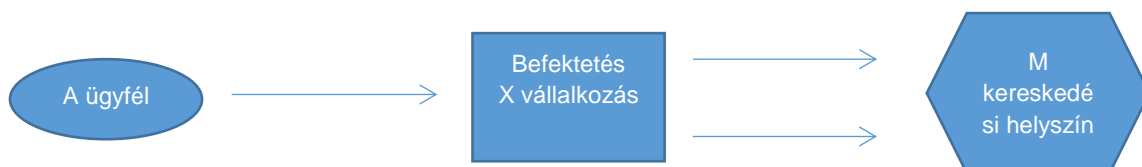
Ha A ügyfél befektetési vállalkozás, akkor jelentésében Y befektetési vállalkozást, mint eladót kell azonosítania.

Ez nem azonos 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek megfelelő szállítással, mert ebben a forgatókönyvben a mögöttes ügyfél lép kapcsolatba azzal a vállalkozással, amelynek bemutatják. X befektetési vállalkozás tulajdonképpen a kapcsolatot továbbítja Y befektetési vállalkozásnak. Ez ellentétes azzal a helyzettel, ahol a kapcsolat a továbbító cégnél marad, amely csak az ügyfél adatait továbbítja.

5.22 Egy ügyfél egyetlen megbízásának végrehajtása több ügyletben

5.22.1 Ügyfél megbízásának teljesítése kereskedési helyszínen, majd az ügyfél kiszolgálása a befektetési vállalkozás saját könyvéből

55. példa



Client A	A ügyfél
Investment Firm X	X befektetési vállalkozás
Trading Venue M	M kereskedési helyszín

A ügyfél 500 részvény vételére ad megbízást X befektetési vállalkozásnak.

X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínen két részletben teljesíti a megbízást, az egyiket, amelyben 300 részvényt vásárol 99 SEK árfolyamon, 2018. június 24-én 14:25:13.159124-kor hajtja végre, a másikat pedig 2018. június 24-én 15:55:13.746133-kor hajtja végre, és ekkor 200 részvényt vesz 100 SEK árfolyamon. Az ügyfél átlagárat akar kapni.

a) X befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik.

Az ügyleteket először X befektetési vállalkozás könyveiben rögzítik, majd ugyanazon a napon 16:24:12-kor 99,40 SEK mennyiséggel súlyozott árfolyamon átkönyvelik az ügyfélre.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T14:25:13.159Z'	'2018-06-24T15:55:13.746Z'	'2018-06-24T16:24:12Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'300'	'200'	'500'
33	Árfolyam	'99'	'100'	'99,40'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty></pre>	<pre><Tx> <New> ...</pre>	<pre><Tx> <New> ...</pre>

<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T14:25:13.159Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:55:13.746Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA AAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:24:12Z</TradDt><Tra dgCpcty>DEAL</TradgCpcty > <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.4</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---	--

b) A befektetési vállalkozás saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végez

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja

16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja
20	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T14:25:13.159'	'2018-06-24T15:55:13.746'
29	Kereskedési szerep	'MTCH'	'MTCH'
30	Mennyiség	'300'	'200'
33	Árfolyam	'99'	'100'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-06-24T14:25:13.159</TradDt> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-06-24T15:55:13.746</TradDt> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </pre>

<pre> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

Noha az ügyfél átlagárat kíván, az ügyletjelentésnek azt kell tükröznie, hogy a piacon teljesült minden egyes ügylet azonnal áthárul az ügyfélre, hiszen a befektetési vállalkozás saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez.

c) A befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik

Az egyéb szerepben eljáró X befektetési vállalkozás ügyletjelentései pontosan megegyeznek azokkal a jelentésekkel, amelyeket saját kitétség nélkül ügyletpárosítás fenti esetében kellett benyújtani, ám kereskedési szerepként A 'MTCH' érték helyett az 'AOTC' értéket kell megjelölni.

5.22.2 Ügyfélmegbízás egy részének teljesítése kereskedési helyszínen, majd az eszközök leszállítása az ügyfélnek a befektetési vállalkozás saját könyvéből

56. példa

A ügyfél 600 részvény vételére ad megbízást X befektetési vállalkozásnak. Az ügyfél átlagárat kíván kapni.

X befektetési vállalkozás A ügyfél megbízását az alábbiak szerint teljesíti:

- 1) M kereskedési helyszínen két részletben teljesíti a megbízást, az egyiket, amelyben 300 részvényt vásárol 99 SEK árfolyamon, 2018. június 24-én 14:25:13.159124-kor hajtja végre, a másikat pedig 2018. június 24-én 15:55:13.746133-kor hajtja végre, és ekkor 200 részvényt vesz 100 SEK árfolyamon.
- 2) Az ügyfélnek 600 részvényt ad át ugyanazon a napon 16:24:12-kor 99,416 SEK átlagos árfolyamon.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. jelentés értékei	2. jelentés értékei	3. jelentés értékei
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja

		jogalany-azonosító {LEI} kódja	jogalany-azonosító {LEI} kódja	
20	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T14:25:13.159Z'	'2018-06-24T15:55:13.746Z'	'2018-06-24T16:24:12Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'300'	'200'	'600'
33	Árfolyam	'99'	'100'	'99.41666666666666'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés (piaci oldali jelentés)	2. jelentés (piaci oldali jelentés)	3. jelentés (ügyfél oldali jelentés)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:13.159Z</TradDt> </Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:13.746Z</TradDt> </Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:24:12Z</TradDt> </Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Tx> </pre>

<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Amt Ccy="SEK">82.833333333333 33</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---

5.23 Megbízások csoportosítása

Az összesített ügyfélszámlát ('INTC') kizárólag az iránymutatásokban ismertetett körülmények között tanácsos használni. Nem helyes sem egyetlen ügyfél egyetlen ügyletének egyetlen végrehajtással teljesített, sem pedig egyetlen ügyfél egyetlen ügyletének több végrehajtás keretében teljesített ügyletének a bejelentésére. Amikor az összesített ügyfélszámlára ('INTC') átvétel történik, a végrehajtó szervezet ügyletjelentésében ugyanazon a munkanapon meg kell jelennie az összesített ügyfélszámlájáról történő megfelelő kivezetésnek is, hogy az összesített ügyfélszámla nullára fusson ki. Az 'INTC' számla látszólagos mozgása az adatszolgáltatásban használt konvenció, amely létrehozza a kapcsolatot a piaci oldal és az ügyfél oldal között, de nem jelenti azt, hogy egy ilyen ügyfélszámla a valóságban is létezik, sem azt, hogy az eszköz tulajdonjoga áthalad a befektetési vállalkozás könyvein.

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 11. cikk (2) bekezdése szerint amikor egy befektetési vállalkozás több ügyfél megbízását összesíti, a 236/2012/EU rendelet short ügyletre vonatkozó rendelkezéseit kell alkalmazni. Ezek szerint a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 11. cikk (2) bekezdése csak az egyedi ügyfelekkel létrejött ügyletek bejelentésére vonatkozik, nem az összesített piaci ügyletjelentésre. Az eladó ügyfelek ügyleteit összesítő piaci ügyletjelentésben a short ügylet megjelölése maradjon üresen. Ennek az oka az, hogy az összesített piaci ügyletjelentés az összes olyan ügyfélre vonatkozik, akinek a megbízása összesítésben szerepel, ezért a short ügylet megjelölését nem lehet a kellő pontossággal meghatározni. Az egyedi ügyfelek esetében a short ügylet megjelölését ezért inkább az egyedi ügyfél oldali ügyletjelentésekben tanácsos közölni (lásd: 5.24. és 5.27.2. bekezdés).

5.23.1 Egy piaci teljesítés több ügyfél számára

57. példa

X befektetési vállalkozás két ügyfele, A ügyfél és B ügyfél 100 illetve 200 részvény eladására ad megbízást.

A ügyfél rövidre ad el. B ügyfél nem tájékoztatja X befektetési vállalkozást, hogy megbízása short ügyletet tartalmaz-e. X befektetési vállalkozás pozíciója semleges. X befektetési vállalkozás összesíti a megbízásokat, és 2018. szeptember 16-án 09:20:15.374215-kor M kereskedési helyszínen egyetlen 300 eszközre szóló ügyletben 25,54 euró árfolyamon végre is hajtja őket. Majd az eszközöket 09:35:10-kor az ügyfeleknek allokálja.

5.23.1.1 X befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-16T09:20:15.374Z'	'2018-09-16T09:35:10Z'	'2018-09-16T09:35:10Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'300'	'100'	'200'
33	Árfolyam	'25,54'	'25,54'	'25,54'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'
62	Short ügylet megjelölése	'SESH'	'SESH'	'UNDI'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789012345 67890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 1</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890< /LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>

<pre> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 16T09:20:15.374Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCp cty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSell gInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09- 16T09:35:10Z</TradDt> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpct y> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> ... <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellg Ind> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 16T09:35:10Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>UNDI</ShrtSell gInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	---	--

Mivel a piaci eladás folytán X befektetési vállalkozásnak rövid pozíciója keletkezne, ezért X befektetési vállalkozásnak ki kellene töltenie az 1. jelentést, hogy ott jelezze ezt attól függetlenül, hogy pozíciója az ügyfelektől való vétel után semlegesre változna (lásd 5.27.2. bekezdés).

5.23.1.2 X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja

7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	„INTC”	„INTC”
16	Az eladó azonosító kódja	„INTC”	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-16T09:20:15.374Z'	'2018-09-16T09:20:15.374Z'	'2018-09-16T09:20:15.374Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'300'	'100'	'200'
33	Árfolyam	'25,54'	'25,54'	'25,54'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'
62	Short ügylet megjelölése		'SESH'	'SELL'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>111111111111111111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... </pre>

<pre> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	---	---

Az ügylet árfolyamát, dátumát és időpontját mind a három ügyletjelentés jelezze. Az ügylet árfolyama, dátuma és időpontja a piaci végrehajtás árfolyam, dátum és időpont legyen. A 2. és a 3. jelentés mutatja be a kereskedési helyszínen "egyéb szerepben" végrehajtott ügyletből az ügyfeleknek allokált részeket. Ezért az ügyfélallokációt mutató jelentésekben ragaszkodni kell a piaci végrehajtás dátumára és időpontjára vonatkozó pontossághoz.

5.23.2 Több piaci teljesítés több ügyfél számára

58. példa

X befektetési vállalkozás három ügyfele, A, B, és C ügyfél 100, 200 illetve 300 db eszköz vételére ad megbízást.

X befektetési vállalkozás vállalta, hogy az ügyfeleknek átlagáron teljesít, ezért összesíti a fenti ajánlatokat, majd M kereskedési helyszínen két ügylettel teljesíti őket, az elsőt (dátum és időpont: 2018. szeptember 15. 11:32:27.431) 400 db eszközre 99 SEK árfolyamon, a másodikat (dátum és időpont: 2018. szeptember 15. 11:42:54.192) 200 db eszközre 100 SEK árfolyamon köti. Az ügyleteket ugyanazon a napon 12:15:23-kor allokáálja az ügyfelekre.

5.23.2.1 X befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik.

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás az ügyletek piaci oldalát?

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-15T11:32:27.431Z'	'2018-09-15T11:42:54.192Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'400'	'200'
33	Árfolyam	'99'	'100'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:42:54. 192Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </pre>

<pre> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	--

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás az ügyleteket az ügyfeleknek?

N	Mező	3. értékközlés	4. értékközlés	5. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	C ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	2018-09-15T12:15:23Z	'2018-09-15T12:15:23Z'	'2018-09-15T12:15:23Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'100'	'200'	'300'
33	Árfolyam	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

3. jelentés	4. jelentés	5. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AA</LEI> </Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCC CCCCCC</LEI> </Id> </pre>

<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</ LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpct y> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333 3</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>123456789012345678 90</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</Tradg Cpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333 333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	---

Mivel X befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, az ügyfél oldali jelentések dátuma és időpontja azt mutatja, mikorallokálta a vállalkozás a pénzügyi eszközöket az ügyfeleknek.

5.23.2.2 X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás az ügyletek piaci oldalát?

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	'INTC'

16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-15T11:32:27.431Z'	'2018-09-15T11:42:54.192Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'400'	'200'
33	Árfolyam	'99'	'100'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:42:54.192Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> </New> </pre>

	<code></Tx></code>
--	--------------------------

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás az ügyfél alokációkat?

N	Mező	3. értékközlés	4. értékközlés	5. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	C ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	'INTC'	'INTC'	'INTC'
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-15T11:32:27.431Z'	'2018-09-15T11:32:27.431Z'	'2018-09-15T11:32:27.431Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'100'	'200'	'300'
33	Árfolyam	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

3. jelentés	4. jelentés	5. jelentés
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCC CCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty></pre>

<pre> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 '</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 '</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.33333333333333 33'</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---	---

A piaci végrehajtás dátumának és időpontjának pontosságához ragaszkodni kell az ügyfél allokációkról benyújtott jelentésben, mivel az ügyleteket a vállalkozás "egyéb szerepben" hajtotta végre.

Amikor X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik, az ügyfél allokációkhoz tartozó kereskedés dátuma és időpontja ne az utolsó, hanem inkább az első piaci végrehajtás dátuma és időpontja legyen.

5.23.2.3 A befektetési vállalkozás saját kitettség nélküli ügyletpárosítást végez

X befektetési vállalkozás nem alkalmazhatja a 'MTCH' értéket, amikor eltérő kereskedési időpontokkal hajtja végre az ügyleteket.

5.23.2.4 X befektetési vállalkozás vegyes kereskedési szerepben kereskedik

59. példa

Az eljárás a fenti példa szerinti, de X befektetési vállalkozás a megbízás egy részét (200 db eszközt 100 SEK árfolyamon) saját könyveiből elégíti ki. Mivel az összesített ügyfélszámlának a nap végére nullára kell kifutnia, és a X vállalkozás több ügyfélmegbízás kielégítésére 200 egységet a saját könyveiből szolgáltat, a jelentésben a piaci oldalnak és az ügyfél allokáció oldalának kiegyenlítése végett tanácsos jelezni az átvezetést X vállalkozás és az 'INTC' számla között. (2. jelentés)

Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás az ügyletek piaci oldalát?

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	'INTC'
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-15T11:32:27.431Z'	'2018-09-15T11:35:30Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'DEAL'
30	Mennyiség	'400'	'200'
33	Árfolyam	'99'	'100'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:35:30Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </pre>

<pre></Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx></pre>	<pre><TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx></pre>
---	---

Hogyan jelentse X befektetési vállalkozás az ügyfél allokációkat?

N	Mező	3. értékközlés	4. értékközlés	5. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	C ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	'INTC'	'INTC'	'INTC'
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-15T11:32:27.431Z'	'2018-09-15T11:32:27.431Z'	'2018-09-15T11:32:27.431Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'100'	'200'	'300'
33	Árfolyam	'99.33333333333333 ,	'99.33333333333333'	'99.33333333333333'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

3. jelentés	4. jelentés	5. jelentés
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAA AAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCC CCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr></pre>

X befektetési vállalkozás belső ügyrendje szerint az ügyfeleket egyenlően kell kezelni, azaz egyikük sem részesülhet előnyösebb elbánásban.

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés	4. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} X vállalkozás	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} X vállalkozás	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} X vállalkozás
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	'INTC'	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} Z vállalkozás jogalany-azonosító {LEI}	kódja	'INTC'	'INTC'
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-24T15:33:33Z'	'2018-07-24T17:55:55Z'	'2018-07-24T15:33:33Z'	'2018-07-24T15:33:33Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'200'	'300'	'250'	'250'
33	Árfolyam	'100,21'	'100,52'	'100,396'	'100,396'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés	4. jelentés
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678 901234567890</Exct gPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr></pre>

<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKL MNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradDt> > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.21</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888 8888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T17:55:55Z</TradDt> > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.52</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradDt> > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.396</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 07- 24T15:33:33Z</TradD t> <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.396 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	--	---	---

A 2018. 07. 25-én végrehajtott ügylet vonatkozásában:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	V vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-25T13:11:11Z	'2018-07-25T13:11:11Z	'2018-07-25T13:11:11Z

29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'500'	'150'	'350'
33	Árfolyam	'100,96'	'100,96'	'100,96'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>VVVVVVVVVVVVVVVVVV VVV</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

5.23.2.5.2 Érkezési sorrendben teljesített megbízások

X befektetési vállalkozás belső ügyrendje szerint az ügyfél allokáció összesített ügyletek esetében időrendi sorrendben történik. Mivel X befektetési vállalkozáshoz először A ügyféltől érkezett megbízás, A ügyfél megkapja a megbízása tárgyát képző összes eszközt (400 db 100,365 euró árfolyamon), és ezzel megbízása maradéktalanul teljesül. A végrehajtás fennmaradó mennyisége B ügyfelet illeti.

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés	4. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} X vállalkozás	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} X vállalkozás	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} X vállalkozás	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	'INTC'	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-24T15:33:33Z'	'2018-07-24T17:55:55Z'	'2018-07-24T15:33:33Z'	'2018-07-24T15:33:33Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'200'	'300'	'400'	'100'
33	Árfolyam	'100,21'	'100,52'	'100,365'	'100,52'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

értékközlés	értékközlés	3. jelentés	4. jelentés
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890 1234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890 1234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>123456 78901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id></pre>

<pre> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</T radgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.21</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradV n> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888 888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 24T17:55:55Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</T radgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.52</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradV n> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 24T15:33:33Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</T radgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.365< /Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>BBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07- 24T15:33:33Z</Tra dDt> <TradgCpcty>AOT C</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.5 2</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</T radVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

A 2018. 07. 25-én végrehajtott ügylet eszközei az 'INTC' számla használata nélkül B ügyfélhez kerülnek.

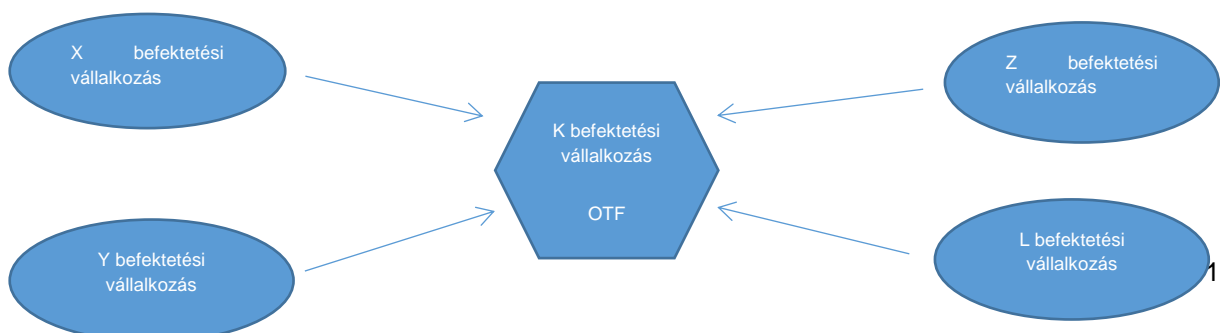
N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtott szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...

7	A vevő azonosító kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
16	Az eladó azonosító kódja	V vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr>
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-25T13:11:11Z'	</Buyr>
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	<Sellr>
30	Mennyiség	'500'	<AcctOwnr>
33	Árfolyam	'100,96'	<Id>
36	Helyszín	'XOFF'	<LEI>VVVVVVVVVVVVVVVVVVVV</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>
			... <Tx> <TradDt>2018-07-25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx>
			... </New> </Tx>

5.24 Szervezett kereskedési rendszer (OTF) saját kitétség nélküli ügyletpárosítása

Amikor egy OTF saját kitétség nélküli ügyfélpárosítást végez, hasonlóan készíti el jelentését, mint egy befektetési vállalkozás. A szervezett kereskedési rendszerrel kereskedő összes fél és az OTF a helyszín mezőben az OTF szegmensazonosító kódját szerepelteti. A saját kitétség nélküli ügyletpárosítást végző OTF egy vagy több ügyfél vételi oldalán szereplő ajánlatát párosítja egy vagy több ügyfél eladási oldalán szereplő ajánlatával.

61. példa



K befektetési vállalkozás, amely egy saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végző OTF (jogalany-azonosítója: OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT, szegmensazonosító kódja: OTFX, algoritmusának kódja '1234ABC'), két befektetési vállalkozástól, az X és az Y vállalkozástól kapott államadósság-instrumentumokra szóló vételi ajánlatot párosít két másik befektetési vállalkozástól, a Z és az L vállalkozástól beérkező két eladási ajánlattal. L befektetési vállalkozás jogalany-azonosítója 77777777777777777777.

X és Y befektetési vállalkozás 300, illetve 100 államadósság-instrumentumot vásárol, Z és L befektetési vállalkozás pedig 150, illetve 250 államadósság-instrumentumot ad el.

X, Y, Z és L befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik. X befektetési vállalkozás nevében a befektetési döntést 1. sz. kereskedő hozta, és ő is hajtotta végre az ügyletet. Y befektetési vállalkozás nevében a befektetési döntést 4. sz. kereskedő hozta, és ő is hajtotta végre az ügyletet. Z befektetési vállalkozás nevében a befektetési döntést 5. sz. kereskedő hozta, és ő is hajtotta végre az ügyletet. L befektetési vállalkozás nevében a befektetési döntést 9. sz. kereskedő hozta, és ő is hajtotta végre az ügyletet. A 9. sz. kereskedő Patrick Down, ír állampolgár, 1960. július 14-én született.

K befektetési vállalkozás az ajánlatokat 2018. június 9-én 16:41:07.1234Z időpontban 42,7 eurós árfolyamon párosítja.

Z befektetési vállalkozás rövidre ad el mentesség nélkül, L befektetési vállalkozás ajánlata nem short ügyletet takar.

Hogyan jelentsen K befektetési vállalkozás (az OTF)?

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés	4. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} K vállalkozás	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} K vállalkozás	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} K vállalkozás	K befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'
16	Az eladó azonosító kódja	'INTC'	'INTC'	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	L befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-09T16:41:07.123Z'	'2018-06-09T16:41:07.123Z'	'2018-06-09T16:41:07.123Z'	'2018-06-09T16:41:07.123Z'
29	Kereskedési szerep	'MTCH'	'MTCH'	'MTCH'	'MTCH'
30	Mennyiség	'300'	'100'	'150'	'250'

33	Árfolyam	'42.7'	'42.7'	'42.7'	'42.7'
36	Helyszín	'K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'	K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'	K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'	K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	{az algoritmus kódja}	{az algoritmus kódja}	{az algoritmus kódja}	{az algoritmus kódja}
62	Short ügylet megjelölése			'SESH'	'SELL'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés	4. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888 888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 09T16:41:07.123Z</Tra dDt> <TradgCpcty>MTCH</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOT FOTFOTFOTFOT</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>777777777777 77777777</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 09T16:41:07.123Z</ TradDt> <TradgCpcty>MTC H</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> </pre>

<pre> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo > </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo > </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo > </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</ Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</Tr adVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</A lgo> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SEL L</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	---	---	---

Tekintve, hogy ebben a példában mindegyik oldalon több ügyfél érintett, a vételi és az eladási oldal összekapcsolásához használni kell az 'INTC' összesített ügyfélszámlát. Lásd 5.23. bekezdés.

Hogyan jelentsék be az OTF ügyfelei a végrehajtott ügyleteket?

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés	4. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	L befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	K befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	K befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	K befektetési vállalkozás	K befektetési vállalkozás	Z befektetési vállalkozás jogalany-	L befektetési vállalkozás jogalany-

		jogalany- azonosító {LEI} kódja	jogalany- azonosító {LEI} kódja	azonosító {LEI} kódja	azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-09T16:41:07.123Z'	'2018-06-09T16:41:07.123Z'	'2018-06-09T16:41:07.123Z'	'2018-06-09T16:41:07.123Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'300'	'100'	'150'	'250'
33	Árfolyam	'42.7'	'42.7'	'42.7'	'42.7'
36	Helyszín	'K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'	'K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'	'K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'	'K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonosító {MIC} kódja'
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	5. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	9. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
62	Short ügylet megjelölése			'SESH'	'SELL'

XML-beli ábrázolás:

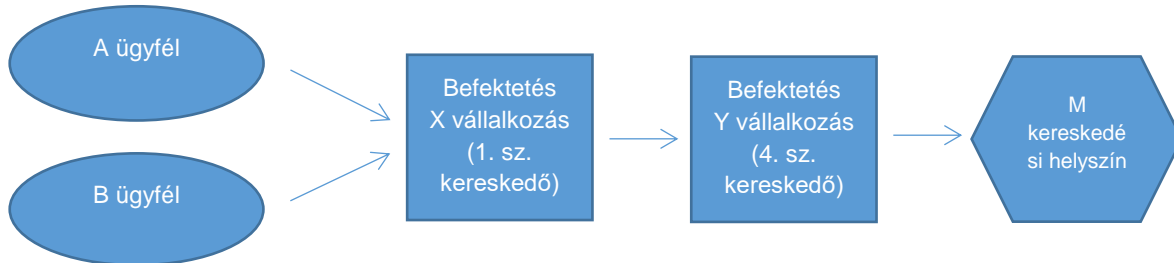
1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés	4. jelentés
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGH HIJKLMNOPQRST</Ex ctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKL MNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>888888888 88888888888</ExctgPt y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>888888888888888 888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>7777777 7777777777777</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT OTFOTFOTFOT</L EI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>77777777777 7777777777</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx></pre>

<pre> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARI ECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>IE19600714PATRI DOWN#</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	--	---	--

5.25 Értékalapú ügyletek kiegyenlítő egységgel

Ez ott fordulhat elő, ahol a befektetési vállalkozás lakossági ügyfeleinek költséghatékony lehetőségként napi összesített kereskedést kínál.

62. példa



X spanyol befektetési vállalkozás két ügyfele ugyanazt a pénzügyi eszközt kívánja megvenni, A ügyfél 400 euró, B ügyfél 200 euró értékben. 1. sz. kereskedő 600 euró értékben küld összesített megbízást Y befektetési vállalkozásnak. 4. sz. kereskedő M kereskedési helyszínen egyetlen ügyletet végrehajtva teljesíti a megbízást, és így 2018. június 24-én 14:25:30.1264-kor 5 db pénzügyi eszközt vesz egyenként 120 euró árfolyamon, majd a végrehajtott ügyletet visszaigazolja X befektetési vállalkozásnak. X befektetési vállalkozás az eszközökből három darabot 360 euró értékben A. ügyfélnek, egyet pedig 120 euró értékben B ügyfélnek allokál. Az eszközökből fennmaradó 1 db kiegyenlítő egységet X befektetési vállalkozás ('ALGOABC') rendszere a vállalkozás saját számlájára helyezi azzal, hogy azt értékesíteni fogja, ha lehet. Ez a birtokbavétel adminisztratív célú, mögötte saját befektetési szándék nem húzódik meg.

X befektetési vállalkozás nem felel meg a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításról írt feltételeknek.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés	4. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
12	Vételi döntéshozó				
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'	'INTC'

21	Eladási döntéshozó kódja				
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T14:25:30Z'	'2018-06-24T14:25:30Z'	'2018-06-24T14:25:30Z'	'2018-06-24T14:25:30Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'DEAL'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'5'	'1'	'3'	'1'
33	Árfolyam	'120'	'120'	'120'	'120'
34	Az ár pénzneme	(EUR)	(EUR)	(EUR)	(EUR)
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		{az algoritmus kódja}		
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország				
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	{az algoritmus kódja}	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'ES'		'ES'	'ES'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés Piaci oldal	2. jelentés Ügyfél oldal	3. jelentés Ügyfél oldal	4. jelentés Ügyfél oldal
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJ </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA</LEI> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </Tx> </pre>

<pre> KLMNOPQRST</LEI > </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T14:25:30Z</Trad Dt> <TradgCpcty>AOTC </TradgCpcty> <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</ CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA11122233344 45555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 24T14:25:30Z</TradDt > <TradgCpcty>DEAL</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Algo>ALGOABC</Al go> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Algo>ALGOABC</Al go> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 24T14:25:30Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>3</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt > </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</Ct ryOfBrnch> <Othr> <Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018- 06- 24T14:25:30Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</T radgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</Ct ryOfBrnch> <Othr> <Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	---	---	--

A 2. jelentésben az 58. és a 60. mező üresen marad, mert az 57. és az 59 mezőben az algoritmus áll. Az 1., 3. és 4. jelentésben üresen marad a vállalkozáson belüli befektetési döntés (57 mező), mert X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" jár el; a 60. mezőben pedig X befektetési vállalkozás országkódja (ES) szerepel, mert az ügyletben fióktelep nem vesz részt.

Ugyanez a helyzet akkor is előadódhat, amikor egy befektetési vállalkozás diszkrecionális megbízás alapján jár el egy ügyfél nevében.

A kiegyenlítő egységre vonatkozó jelentés esetében az 57. mezőben a vállalkozás algoritmusának kódja szerepeljen, hiszen a döntést ugyan a vállalkozás hozta, de nem egy természetes személy.

5.26 Lánccok és továbbítás

Ez a bekezdés az alábbiakkal kapcsolatosan közöl példákat:

- a) Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek nem teljesülnek (**Error! Reference source not found.** albekezdés).
- b) Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek teljesülnek, de a 4. cikk nem minden feltétele teljesül (5.26.2. albekezdés).
- c) Olyan láncok, ahol továbbítás valósul meg, és a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek az összes befektetési vállalkozás megfelel (5.26.3. albekezdés).
- d) Olyan láncok, ahol a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek csak néhány befektetési vállalkozás felel meg (5.26.4. albekezdés).

A láncok és a továbbítás általános ismertetését lásd az I. rész megfelelő bekezdéseiben (**Error! Reference source not found.**).

63. példa



1. sz. ügyfél X befektetési vállalkozás ügyfeleként néhány részvény eladása mellett dönt, és utasítást ad X befektetési vállalkozásnak. 1. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja 1. sz. ügyfél megbízását, majd eldönti, hogy Y befektetési vállalkozásnak küldi meg azt. 4. sz. kereskedő úgy dönt elfogadja a megbízást X befektetési vállalkozástól, majd eldönti, hogy Z befektetési vállalkozásnak küldi meg azt. Z befektetési vállalkozás 5. sz. kereskedője úgy dönt, elfogadja a megbízást Y befektetési vállalkozástól, majd Z vállalkozás 'ALGO12345' algoritmusával M kereskedési helyszínt választja ki, hogy oda küldjék be a megbízást. Ekkor a megbízást Z befektetési vállalkozás M kereskedési helyszíni ajánlati könyvében 2018. július 1-én 13:40:23.4672-kor 32,5 euró árfolyamon teljesíti. M kereskedési helyszíni ügylet az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendel.

5.26.1 Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek nem teljesülnek

A következő példa azt mutatja be, mi szerepeljen az ügyletjelentésben olyan láncok esetében, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek nem teljesülnek, és mindegyik befektetési vállalkozás a saját közvetlen üzleti partnerét vagy ügyfelét jelenti be, illetve azt, hogy ilyen forgatókönyv esetében hogyan tanácsos a továbbításra vonatkozó 25-27. mezőket kitölteni. Ez akkor fordul elő, amikor egy befektetési vállalkozás saját kitétsége nélkül ügyletpárosítást végez vagy saját számlára kereskedik. Ennek a láncnak az általános ismertetését lásd az iránymutatások I. részében, az 5.3.2. albekezdésben.

64. példa

Y és Z befektetési vállalkozás saját kitétsége nélkül ügyletpárosítást végez, X befektetési vállalkozás pedig saját számlára kereskedik.

X, Y és Z befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1.	1.	1.	2.
		értékközlés Z befektetési vállalkozás	értékközlés Y befektetési vállalkozás	értékközlés X befektetési vállalkozás	értékközlés X befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszíni ügyletazonosító kódja	'1234'			
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési	Z befektetési vállalkozás	X befektetési vállalkozás	Y befektetési vállalkozás

		helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	jogalany-azonosító {LEI} kódja	jogalany-azonosító {LEI} kódja	jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában				
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában				
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-01T13:40:23.467Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'
29	Kereskedési szerep	'MTCH'	'MTCH'	'DEAL'	'DEAL'
33	Árfolyam	'32,5'	'32,5'	'32,5'	'32,5'
34	Az árfolyam pénzneme	(EUR)	(EUR)	(EUR)	(EUR)
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés			1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	{az algoritmus kódja}	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

XML-beli ábrázolás:

Z befektetési vállalkozás 1. jelentése	Y befektetési vállalkozás 1. jelentése	X befektetési vállalkozás 1. jelentése	X befektetési vállalkozás 2. jelentése
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...
<ExctgPty>888888888	<ExctgPty>ABCDEFGF	<ExctgPty>123456789	<ExctgPty>12345678

<p>888888888888</ExctgPty></p> <p>...</p> <p><Buyr> <AcctOwnr> <Id></p> <p><LEI>11111111111111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id></p> <p><LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr></p> <p>...</p> <p><OrdTrnsmssn></p> <p><TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt></p> <p><TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty></p> <p>...</p> <p><Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric></p> <p>...</p> <p><TradVn>XMIC</TradVn></p> <p>...</p> <p><TradPlcMtchglD>1234</TradPlcMtchglD></p> <p>...</p> <p></Tx></p> <p>...</p>	<p>HIJKLMNOPQRST</ExctgPty></p> <p>...</p> <p><Buyr> <AcctOwnr> <Id></p> <p><LEI>88888888888888888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id></p> <p><LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr></p> <p>...</p> <p><OrdTrnsmssn></p> <p><TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt></p> <p><TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty></p> <p>...</p> <p><Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric></p> <p>...</p> <p><TradVn>XOFF</TradVn></p> <p>...</p> <p></Tx></p> <p>...</p> <p><ExctgPrsn> <Prsn></p> <p>...</p> <p><Othr></p>	<p>01234567890</ExctgPty></p> <p>...</p> <p><Buyr> <AcctOwnr> <Id></p> <p><LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn></p> <p>...</p> <p><Othr></p> <p><Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry></p> <p></SchmeNm> </Othr> </Prsn></p> <p></Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn></p> <p><TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt></p> <p><TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty></p> <p>...</p> <p><Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric></p> <p>...</p> <p><TradVn>XOFF</TradVn></p> <p>...</p> <p></Tx></p> <p>...</p> <p><MntryVal> </Pric> </Pric></p> <p>...</p>	<p>901234567890</ExctgPty></p> <p>...</p> <p><Buyr> <AcctOwnr> <Id></p> <p><LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id></p> <p><LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr></p> <p><OrdTrnsmssn></p> <p><TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt></p> <p><TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty></p> <p>...</p> <p><Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric></p> <p>...</p> <p><TradVn>XOFF</TradVn></p> <p>...</p> <p></Tx></p> <p>...</p> <p><InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr></p>
---	---	--	---

<pre> <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</ Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id>FR19631202MAR IECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</ Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradVn>XOFF</Trad Vn> ... </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA111222333444 5555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id>CA11122233344 45555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA11122233344 45555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	---	--	---

25. mező: Egyik vállalkozás sem továbbított megbízást, hiszen saját számlára kereskednek vagy saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végeznek, ezért ebben a mezőben a 'false' (hamis) értéket szerepeltetik.

26. és 27. mező: Ezeket a mezőket csak az átvevő befektetési vállalkozás tölti ki, amennyiben a továbbítás feltételei teljesülnek. Mivel itt nem ez a helyzet, a mezők üresen maradnak.

Egy adott ügyleten belül a kötésben álló párok időpontja és árfolyama egyezzen meg (pl. Z befektetési vállalkozás által az Y befektetési vállalkozással létrejött ügylet bejelentett időpontja legyen azonos azzal az időponttal, amelyet Y befektetési vállalkozás a Z befektetési vállalkozással kötött ügyletről jelent be figyelembe véve a vállalkozásokra vonatkozó eltérő pontossági követelményeket – az időbélyegző pontosságáról lásd a 7.2. bekezdést. A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerinti 28. mezőben csak a kereskedési helyszín piaci oldali jelentését kell bejelenteni a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 3. cikkében és a mellékletének 2. táblázatában rögzített pontossági követelményeknek megfelelően, ezért X és Y jelentésében csak másodperc pontosságig kötelező az időpontot megadni (bár nagyobb felbontásban is lehet). X befektetési vállalkozás jelentésében szerepeltetheti a végrehajtásnak az Y befektetési vállalkozás által neki visszaigazolt idejét.

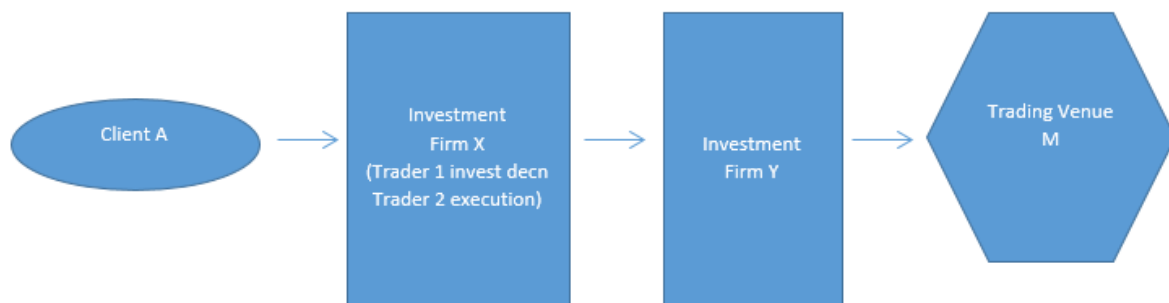
Az 1. sz. ügyféllel kötött ügyletnek az X befektetési vállalkozás által bejelentett dátuma és időpontja eltérhet attól a dátumtól és időponttól, amelyet X befektetési vállalkozás az Y befektetési vállalkozással kötött ügyletre vonatkozóan bejelent, mert a részvények allokációja az ügyfélre az ügylethez képest más időpontban történhet, mint a piaci üzleti partnerrel létrejött ügylet, sőt az árfolyam is eltérő lehet.

5.26.2 Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek teljesülnek, de a 4. cikk nem minden feltétele teljesül

Az alábbi példák azt mutatják be, hogy a 25. mező kivételével ugyanúgy kell bejelenteni azokat a láncokat, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek teljesülnek, de a 4. cikk nem minden feltétele teljesül, mint azokat, ahol a 4. cikk szerinti egyetlen feltétele sem áll fenn.

5.26.2.1 Egyszerű lánc

65. példa



Client A	A ügyfél
Investment Firm X (Trader 1 invest decn Trader 2 execution)	X befektetési vállalkozás (1. kereskedő befektetési döntés 2. kereskedő végrehajtás)
Investment Firm Y	Y befektetési vállalkozás
Trading Venue M	M kereskedési helyszín

1. sz. kereskedő úgy dönt, diszkrecionális megbízása alapján A ügyfél részére pénzügyi eszközt vesz, majd 2. sz. kereskedő az eszköz megvásárlására Y befektetési vállalkozásnak ad megbízást. A saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végző Y befektetési vállalkozás a megbízást M kereskedési helyszínen 2018. június 1-én 14:51:09.123-kor 32,5 euró árfolyamon 'ALGO12345' azonosító kódú algoritmusával végrehajtja.

M kereskedési helyszín az ügylethez az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli.

Y és X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés Y befektetési vállalkozás	Értékközlés X befektetési vállalkozás
---	------	--	--

3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
12	Vételi döntéshozó kódja		X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	„igaz”
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában		
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában		
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-01T14:51:09.123Z'	'2018-06-01T14:51:09Z'
29	Kereskedési szerep	'MTCH'	'AOTC'
33	Árfolyam	'32,5'	'32,5'
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	{az algoritmus kódja}	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

XML-beli ábrázolás:

Y befektetési vállalkozás jelentése	X befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> </pre>

<pre> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 01T14:51:09.123Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <AcctOwnc> </Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-01T14:51:09Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	---

Y befektetési vállalkozás nem keresi X befektetési vállalkozás mögött a befektetőt, és vevőként X befektetési vállalkozást jelenti be. X befektetési vállalkozás szintén nem néz Y befektetési vállalkozás mögé a helyszínig, hanem azt 'XOFF' értékkel szerepelteti a jelentésében.

X befektetési vállalkozás ugyanakkor a 25. mezőben a 'true' (igaz) értéket állítja be az ügyletjelentésében, mert a vállalkozás annak ellenére megbízást továbbít, hogy a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek nem felel meg. Ugyanebből az okból marad üresen a 26. és a 27. mező is.

Ha X befektetési vállalkozás nem lenne befektetési vállalkozás, és így a továbbítás semmilyen esetben nem vonatkozhatna rá, akkor az illetékes hatóság kizárólag Y vállalkozás jelentését kapná meg.

5.26.2.2 Hosszabb lánc

66. példa

Az alábbiak az 5.26. bekezdés elején ismertetett esettel azonos forgatókönyvre épülnek azzal az eltéréssel, hogy X, Y és Z befektetési vállalkozás egyaránt "egyéb szerepben" jár el.

N	Mező	Z befektetési vállalkozás értékközlése	Y befektetési vállalkozás értékközlése	X befektetési vállalkozás értékközlése
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'		
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'true' (igaz)	'true' (igaz)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában			
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában			
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-01T13:40:23.467Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
33	Árfolyam	'32,5'	'32,5'	'32,5'
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín	'XOFF'	'XOFF'



		szegmensazonosító {MIC} kódja		
--	--	-------------------------------	--	--

XML-beli ábrázolás:

Z befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése	X befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>8888888888888888888888 8888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123 4567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> </pre>

<pre><TradPlcMtchId>1234</TradPlcMtchId> ... </Tx> ... </New> </Tx></pre>	<pre></New> </Tx></pre>	<pre>... </New> </Tx></pre>
---	-------------------------------------	---

Az időpont a vállalkozásokra vonatkozó eltérő pontossági követelményeket figyelembe véve mindegyik jelentésben legyen azonos – lásd 7.2. bekezdés az időbélyegző pontosságáról. Ez azért van így, mert a vállalkozások egyéb szerepben járnak el, így minden jelentés ugyanarra az ügyletre vonatkozik. Csak a kereskedési helyszín piaci oldali jelentését kell bejelenteni a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 3. cikkében és a mellékletének 2. táblázatában rögzített pontossági követelményeknek megfelelően, ezért X és Y jelentésében csak másodperc pontosságig kötelező az időpontot megadni (bár nagyobb felbontásban is lehet). Y befektetési vállalkozás jelentésében szerepeltetheti a végrehajtásnak az Z befektetési vállalkozás által neki visszaigazolt idejét, X befektetési vállalkozás pedig azt az időpontot állíthatja be a jelentésébe, amelyet neki Y befektetési vállalkozás visszaigazolt.

Ez az adatszolgáltatás tulajdonképpen azonos egy olyan lánc bejelentésével, ahol a befektetési vállalkozások saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végeznek azzal a kivétellel, hogy a megbízástovábbítás megjelölése mezőbe, ahol a 'true' (igaz) érték szerepel azon továbbító vállalkozások esetében, amelyek nem felelnek meg a feltételeknek, a 'false' (hamis) értéket kell beállítani, ha a vállalkozás saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez, tehát nem továbbít megbízást.

Függetlenül attól, hogy az eszköz származtatott termék-e, X és Y befektetési vállalkozás jelentéseiben, a 36. mezőben az 'XOFF' érték áll, mert a jelentések nem a kereskedési helyszínen történő közvetlen végrehajtásra vonatkoznak.

5.26.2.3 A MiFIR hatálya alá nem tartozó vállalkozást tartalmazó láncok

5.26.2.3.1 *Megbízás elküldése adatszolgáltatási kötelezettség nélküli vállalkozásnak*

67. példa

X befektetési vállalkozás diszkrecionális megbízása alapján úgy dönt, jelentendő eszközt vásárol A ügyfél számára. A befektetési döntést 1. sz. kereskedő hozza, 2. sz. kereskedő pedig eldönti, hogy a megbízást X vállalkozás kapcsolt vállalkozásának, G vállalkozásnak küldi el végrehajtásra. X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik. G vállalkozás USA illetőségű önálló jogalany, amelynek jogalany-azonosítója GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1.	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre><Tx> <New> ...</pre>

7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
12	Vételi döntéshozó kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	G vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr>
21	Eladási döntéshozó kódja		</Buyr> <Sellr>
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'true' (igaz)	<AcctOwnr> <Id>
36	Helyszín	'XOFF'	<LEI>GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG</LEI>
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	> </Id> </AcctOwnr>
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	</Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

X befektetési vállalkozás nem köteles közvetlen üzleti partnerénél messzebbre tekinteni, ezért amerikai leányvállalatát, azaz G vállalkozást jelenti be eladóként.

Az 59. mezőben 2. sz. kereskedő nemzeti ügyfélazonosítója áll, mert ő döntött arról, hogy a megbízást G. vállalkozásnak adja.

G vállalkozás nem tesz bejelentést, mert nem befektetési vállalkozás.

5.26.2.3.2 Ajánlat beérkezése adatszolgáltatási kötelezettség nélküli vállalkozástól

68. példa

H vállalkozás, mint amerikai befektetéskezelő (jogalany-azonosítója HHHHHHHHHHHHHHHHHHHHHHH) diszkrecionális megbízása alapján befektetési döntést hoz A ügyfele számára jelentendő eszköz vételéről. A vállalkozás a megbízást leányvállalatának, X befektetési vállalkozásnak küldi el végrehajtásra. Az X befektetési vállalkozás nevében eljáró 1. sz. kereskedő a megbízást Z befektetési vállalkozással hajtja végre.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1.	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> >
7	A vevő azonosító kódja	H vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>HHHHHHHHHHHHHHHHHHHHHH</LEI> </Id> </AcctOwnr>
12	Vételi döntéshozó kódja		
16	Az eladó azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr>
21	Eladási döntéshozó kódja		</Sellr>
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	<OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd>
36	Helyszín	'XOFF'	</OrdTrnsmssn>
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		<Tx> ... <TradVn>XOFF</TradVn>
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	</Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn>

			<pre> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

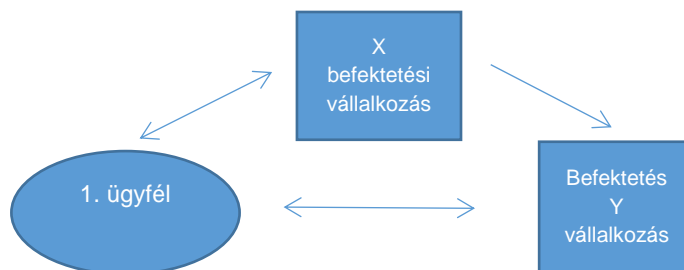
X befektetési vállalkozás nem köteles közvetlen ügyfele mögé tekinteni, H vállalkozás pedig nem továbbíthat a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételek szerint, hiszen nem befektetési vállalkozás, ezért X befektetési vállalkozásnak tanácsos az amerikai leányvállalatot, azaz H vállalkozást, mint vevőt bejelenteni.

H vállalkozás nem tesz bejelentést, mert nem befektetési vállalkozás.

X befektetési vállalkozás és ügyfele diszkrecionális megbízás alapján járnak el, mindketten a végrehajtó Y befektetési vállalkozás ügyfeleiként.

69. példa

Tekintve, hogy a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4.cikke szerint a továbbításnak nincs olyan esete, ahol a befektetéskezelő jogalany diszkrecionális megbízás alapján jár el, ezért a megbízást átvevő befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha a diszkrecionális megbízás alapján eljáró jogalanyt, mint eladót/vevőt bejelenti. Még ott is ez a helyzet, ahol a befektetéskezelő jogalany szintén az átvevő befektetési vállalkozás ügyfele, függetlenül attól, hogy a diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetéskezelő jogalany befektetési vállalkozásnak minősül-e vagy sem.



1. sz. ügyfél Y befektetési vállalkozás ügyfele, és ügyfele X befektetési vállalkozásnak is.

X befektetési vállalkozás 1. sz. ügyféltől diszkrecionális megbízást kapott, és úgy dönt, hogy számára néhány pénzügyi eszközt vesz, ezért megbízást ad Y befektetési vállalkozásnak.

X befektetési vállalkozás nem felel meg a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításról írt feltételeknek.

Hogyan jelentsen X befektetési vállalkozás a vevő/eladó mezőben?

Y befektetési vállalkozás vevőként inkább X befektetési vállalkozást, mintsem 1. sz. ügyfelet tüntesse fel.

5.26.3 Olyan láncok, ahol a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek az összes befektetési vállalkozás megfelel.

A továbbító befektetési vállalkozásnak kizárólag a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt információt kell megadnia, és azt is csak olyan értékben, amennyiben az a szóban forgó megbízásra vonatkozik. Például, olyan EU-n kívüli szervezett kereskedési platformon kereskedett pénzügyi eszköz esetében, amelynél az alapul szolgáló pénzügyi eszköz olyan kereskedési helyszínen forog, amelynek nincs ISIN kódja, a továbbító befektetési vállalkozás nem adná meg az ISIN kódot, hiszen az nem létezik, ezért az az adott megbízásra nem vonatkozik. Emellett ugyan a továbbító befektetési vállalkozás a 42-56. mezőben közölne információt, ha magáról az ügyletről tenne bejelentést, ezt az információt nem köteles megadni az átvevő befektetési vállalkozásnak nyújtott továbbítási adatok részeként³¹. Az ügyletjelentésben az átvevő befektetési vállalkozás által feltüntetett bármely további információt az átvevő befektetési vállalkozásnak kell kitöltenie saját adataiból a tényleges végrehajtás(ok) alapján. Az átvevő befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha csak a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletében meghatározott mezők kitöltésére használja fel a továbbító befektetési vállalkozástól származó információt.

A továbbító befektetési vállalkozás által közzéteendő árfolyam és mennyiség nem más, mint az ajánlati árfolyam és mennyiség, és a továbbító befektetési vállalkozás nem köteles a végrehajtás tényleges árfolyamát és mennyiségét visszaigazolni csak akkor, ha az allokáció egynél több ügyfelet érint, és ilyen esetben a továbbító befektetési vállalkozásnak meg kell adnia az egyes ügyfeleknek allokálandó mennyiséget.

Annak azonosítása, hogy az átvevő befektetési vállalkozásnak kit kell vevő(k)ként/eladó(k)ként bejelentenie csak attól függ, teljesülnek-e a továbbítás feltételei. Így amikor az ügyfélallokációról a megbízás időpontjában információ érkezik, például az elszámoláshoz, de továbbítási szerződés nem létezik, vagy a továbbítási valamelyik feltétele nem teljesül, az átvevő vállalkozás a megbízást küldő befektetési vállalkozást jelenti be eladóként/vevőként.

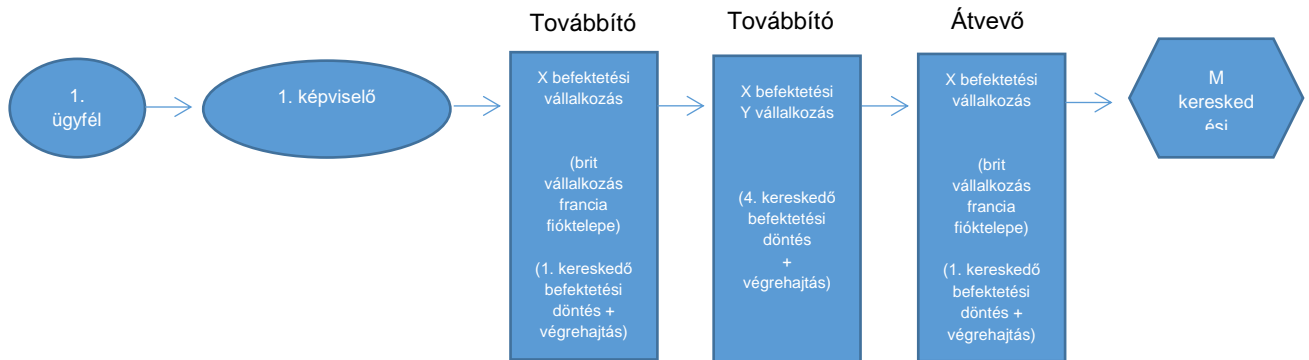
Figyelmet érdemel, hogy amikor valamelyik mező (zöld kiemeléssel) akként van megjelölve, hogy azt a továbbító befektetési vállalkozás tölti ki információval, és az alábbi példákban az ilyen mező mégis üres, annak az az oka, hogy a továbbító befektetési vállalkozás azt üresen továbbította (azaz a mező az adott esetre nem vonatkozik).

Az alábbi példák bemutatják, hogy milyen információkat köteles a továbbító befektetési vállalkozás az átvevő befektetési vállalkozás számára megadni, ezek közül az átadott információk közül mely adatokat

³¹ A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikk (2) bekezdésének a) pontja előírja, hogy a pénzügyi eszközt az "azonosító kóddal" kell azonosítani.

és hogyan kell az átvevő befektetési vállalkozásnak a saját információi helyett a jelentésében feltüntetni. Azt is megmutatják, hogy a továbbító vállalkozás azonosító kódjával a vevő/eladó mezőben bejelentett jogalanynak inkább a végső továbbítónak, mintsem annak a továbbító befektetési vállalkozásnak kell lennie, amely az információt az átvevő befektetési vállalkozásnak átadta.

70. példa



1. sz. ügyfél X befektetési vállalkozás ügyfele. 1. képviselő az 1. sz. ügyféltől kapott meghatalmazás alapján eljárva úgy dönt, egyenként legalább 31 euróért eladja az 1. sz. ügyfél tulajdonában lévő 523 db árualapú származtatott terméket, és erre utasítást ad X befektetési vállalkozás francia fióktelepének. X vállalkozás brit központjának felügyelete alá tartozó 1. sz. kereskedő elfogadja a 1. képviselőtől a megbízást, és utasítást ad Y befektetési vállalkozásnak. 4. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja X befektetési vállalkozás megbízását, és azt elküldi Z befektetési vállalkozásnak. Z befektetési vállalkozás az Egyesült Királyságban működő vállalkozás. 5. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja Y befektetési vállalkozás megbízását, és azt 6. sz. kereskedő elküldi M kereskedési helyszínre.

A megbízás M kereskedési helyszín ajánlati könyvében 2018. július 1-én 13:40:23.4672-kor 500 db pénzügyi eszközre 32,50 euró árfolyamon részlegesen teljesül. A kereskedési helyszín az ügylethez az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli.

Az árualapú származtatott termékek ISIN kódja XX000000001.

Ügyfél a 2014/65/EU irányelv 57. cikkének megfelelően objektíven mérhető módon csökkenti a kockázatát.

X és Y befektetési vállalkozás egyaránt teljesíti a továbbítás feltételeit.

X befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha az alábbiakat közli Y befektetési vállalkozással:

- 1) A pénzügyi eszköz azonosító kódját: a pénzügyi eszköz ISIN kódja (XX000000001)
- 2) Azt a tényt, hogy a megbízás a pénzügyi eszköz eladására szól
- 3) A megbízás árfolyamát és mennyiségét (523 pénzügyi eszköz legalább 31 euró árfolyamon)
- 4) Az eladó megjelölését: 1. sz. ügyfél nemzeti azonosítója
- 5) 1. sz. ügyfél adatait:

- a) vezetéknev és utónév
- b) születési idő
- 6) A döntéshozó megjelölését és adatait: 1. képviselő nemzeti ügyfélazonosítója, vezetékneve, utóneve és születési ideje
- 7) Annak megjelölését, hogy a továbbító félnél személy vagy algoritmus a felelős a befektetési döntésért (X befektetési vállalkozás): üresen marad (mivel a befektetési döntést a vállalkozáson kívül hozzák – a döntést 1. képviselő hozta).
- 8) A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország: üresen marad
- 9) Az ügyféltől a megbízást átvevő X befektetési vállalkozás fióktelepe szerinti ország: FR
- 10) Árualapú származtatott termék megjelölése: true (igaz)
- 11) A továbbító befektetési vállalkozást azonosító kód: X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja

Mivel Y befektetési vállalkozás szintén továbbító, akkor jár el helyesen, ha Z befektetési vállalkozásnak ugyanazt az információt adja át, amelyet X befektetési vállalkozástól kapott a továbbító befektetési vállalkozást azonosító kóddal, tehát jelen esetben X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító kódjával együtt.

A 27. mezőben az X befektetési vállalkozást kell szerepeltetni, mert végső soron X befektetési vállalkozás továbbította azt az információt, amelyet Z befektetési vállalkozás Y befektetési vállalkozásnak adott át.

A fenti 1., illetve 4-10. pontok esetében az információ pontosan megegyezik azzal, amit X befektetési vállalkozás akkor jelentene, ha nem felelne meg a továbbítás feltételeinek, és saját ügyletjelentését küldené el.

A következő példánál Z befektetési vállalkozás jelentésében a zölddel kiemelt mezők közvetlenül a továbbító befektetési vállalkozástól, azaz az Y befektetési vállalkozástól származó információkat tüntetik fel.

Mivel mind X, mind Y vállalkozás teljesíti a továbbítás feltételeit, bejelentési kötelezettségük nincs.

5.26.3.1 Az átvevő befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik.

Z befektetési vállalkozás mindezt így jelentse:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja

7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja
17	A fióktelep helye szerinti ország eladó esetében		'FR'
18	Eladó utóneve(i)		'JEAN'
19	Eladó vezetékneve(i)		'COCTEAU'
20	Eladó – születési dátum		1962. 06. 04.
21	Eladási döntéshozó kódja		1. képviselő {NATIONAL_ID}-ja
22	Eladási döntéshozó – valamennyi utónév		'FABIO'
23	Eladási döntéshozó – valamennyi vezetéknev		'LUCA'
24	Eladási döntéshozó – születési dátum		1962. 10. 11.
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában		
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában		X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-01T13:40:23.467Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	500	500
33	Árfolyam	'32,5'	'32,5'
34	Az ár pénzneme	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'
41	Eszközazonosító kód	Instrumentum {ISIN} száma	Instrumentum {ISIN} száma
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	5. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország	'GB'	
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	6. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	6. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'GB'	'GB'
64	Árualapú származtatott termék megjelölése	'false' (hamis)	'true' (igaz)

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés (piaci oldal)	2. jelentés (ügyszél oldal)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglD>1234</TradPlcMtchglD> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> </Prsn> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> </Prsn> <Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> </pre>

<pre> <Othr> <Id>F11234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> ... <RskRdcgTx>false</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Tx> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
---	--

57. mező: mivel Z befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, a befektetési döntést is maga hozza, a Z befektetési vállalkozásnál a befektetési döntést hozó (5. sz. kereskedő) adatait a piaci oldal jelentésében tanácsos az 57. mezőben szerepeltetni. Az ügyfél oldali jelentésben itt a továbbító befektetési vállalkozástól kapott adatok szerepelnek. Ebben a példában ez a mező üresen marad, mert X befektetési vállalkozástól is üresen érkezett az információ (hiszen a döntést 1. képviselő hozta).

58. mező: Ugyan a megbízás egy fiókteleptől származik, a döntést az ügyfél (vagy képviselője) hozta, és ezért az ügyfél oldal jelentésében a mező üres marad.

Az időpontnak és az árfolyamnak (a pontosságra vonatkozó követelményeket is figyelembe véve) azonosnak kell lennie, de az ügyfél oldal jelentésében az időpont lehet későbbi, azaz tükrözheti azt az időpontot, amikor az ügyfél tulajdonba került. Csak Z befektetési vállalkozás piaci oldali jelentésében

kell az időpontot mikroszekundum pontosság szerint feltüntetni. Az ügyfél oldali jelentésben a másodperc pontossággal kell az időpontot megadni (bár Z befektetési vállalkozás ennél nagyobb pontossággal is jelenthet).

5.26.3.2 Fogadó vállalkozás "saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez/egyéb szerepben jár el"

71. példa

Ha a fogadó befektetési vállalkozás, azaz Z vállalkozás saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez, az alábbiak szerint tanácsos jelentenie:

N	Mező	1.	XML-beli ábrázolás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	<Tx> <New>
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <ExctgPty>88888888888888888888888888888888</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja	<LEI>11111111111111111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
17	A fióktelep helye szerinti ország az eladó esetében	'FR'	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr>
18	Eladó utóneve(i)	'JEAN'	
19	Eladó vezetékneve(i)	'COCTEAU'	<Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id>
20	Eladó – születési dátum	1962. 06. 04.	<SchmeNm>
21	Eladási döntéshozó kódja	1. sz. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	<Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr>
22	Eladási döntéshozó – valamennyi utónév	'FABIO'	</Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch>
23	Eladási döntéshozó – valamennyi vezetéknev	'LUCA'	</AcctOwnr> <DcsnMakr>
24	Eladási döntéshozó – születési dátum	1974. 10. 11.	<Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr>
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában		<Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm>

27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} vállalkozás	<pre> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglD>1234</TradPlcMtchglD> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-01T13:40:23.467Z'	
29	Kereskedési szerep	'MTCH'	
30	Mennyiség	500	
33	Árfolyam	'32,5'	
34	Az ár pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	
41	Eszközazonosító kód	Instrumentum {ISIN} száma	
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország		
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	6. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	
64	Árualapú származtatott termék megjelölése	'true' (igaz)	

Amikor Z befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" jár el, az ügyletjelentés a fenti jelentéssel teljesen azonos lesz azzal az eltéréssel, hogy a 29. mezőben kereskedési szerepként az 'AOTC' értéket kell feltüntetni.

5.26.3.3 Az ügyfélnek ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége van.

72. példa

Feltételezzük, hogy az ügyfél nem 1. sz. ügyfél, hanem A ügyfél, amely egyben befektetési vállalkozás is. A ügyfél akkor jár el helyesen, ha az X befektetési vállalkozás által visszaigazolt árfolyamot és időpontot tünteti fel a jelentésben. Ha azt feltételezzük, hogy Z befektetési vállalkozás kereskedési szerepe szerint "egyéb szerepben" jár el, vagy "saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez", akkor A ügyfél ügyletjelentésében az árfolyam és az időpont – a felbonthatóságra vonatkozóan a 7.2. bekezdésben előírt követelményeket is figyelembe véve – ugyanaz lesz, mint Z befektetési vállalkozásnál, hiszen X, Y és Z befektetési vállalkozás egyaránt "egyéb szerepben" jár el, ezért mindez egyetlen ügyletnek tekintendő. Ha Z befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, az árfolyam és az időpont eltérhet. A ügyfél akkor jár el helyesen, ha vevőként X befektetési vállalkozást azonosítja, mert vele állt üzleti kapcsolatban.

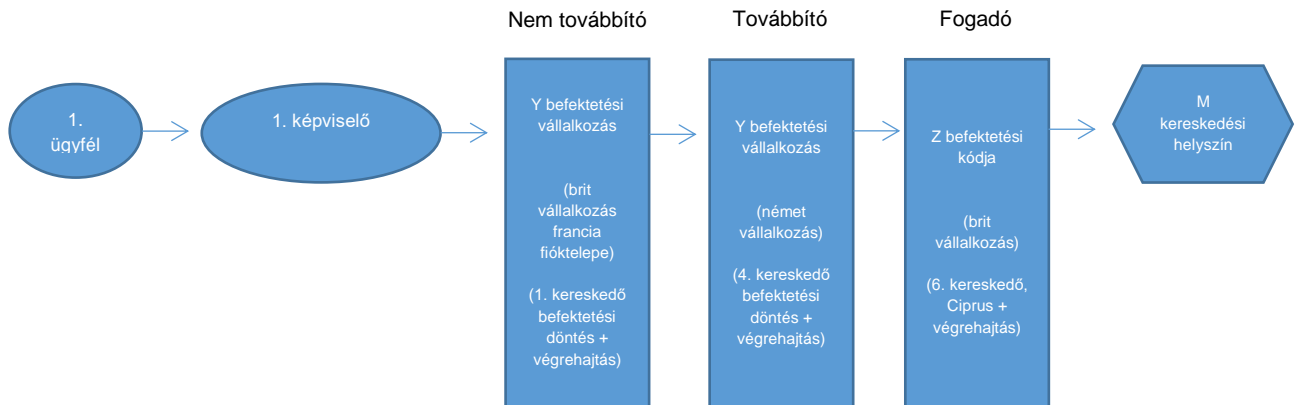
Z befektetési vállalkozás adatszolgáltatásának pedig (kereskedési szerepétől függően) az 5.26.3.2. bekezdésben bemutatott példákkal kell azonosnak lennie azzal az eltéréssel, hogy A ügyfél azonosítására annak jogalany-azonosító kódját kell szerepeltetnie, és az árualapú származtatott termék megjelölésénél hamis szerepel.

5.26.4 Olyan láncok, ahol a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek a láncban néhány befektetési vállalkozás megfelel

A következő példa azt mutatja be, hogy a továbbító befektetési vállalkozásnak jeleznie kell, hogy ő saját maga vagy egy másik fél áll-e továbbító befektetési vállalkozások sorának elején.

5.26.4.1 A végső ügyféllel kereskedő befektetési vállalkozás nem teljesíti a továbbítási feltételeit

73. példa



1. sz. ügyfél X befektetési vállalkozás ügyfele. 1. képviselő az 1. sz. ügyféltől kapott meghatalmazás alapján eljárva úgy dönt, elad néhány az 1. sz. ügyfél tulajdonában lévő részvényt, és erre utasítást ad X befektetési vállalkozás francia fióktelepének. A brit központ felügyelete alá tartozó 1. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja a 1. ügyféltől a megbízást, és elhatározza, hogy azt a német Y befektetési vállalkozásnak küldi el. 4. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja Y befektetési vállalkozástól a megbízást, és továbbküldi azt Z befektetési vállalkozásnak. 5. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja Y befektetési vállalkozás megbízását, és azt a ciprusi fióktelep felügyelete alá tartozó 6. sz. kereskedő elküldi M kereskedési helyszínre. X befektetési vállalkozás és Y vállalkozás "egyéb szerepben", míg Z befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik.

A megbízást Z befektetési vállalkozás M kereskedési helyszín ajánlati könyvében 2018. július 1-én 13:40:23.4672-kor 32,50 euró árfolyamon teljesíti. A kereskedési helyszín az ügylethez az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli. X befektetési vállalkozás úgy dönt, nem adja tovább az adatokat Y befektetési vállalkozásnak.

Y befektetési vállalkozás továbbítja a többi szükséges információval együtt ügyfele (azaz X befektetési vállalkozás) adatait Z befektetési vállalkozásnak, és megfelel a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításra vonatkozóan írt egyéb feltételeknek.

Y befektetési vállalkozás német illetőségű.

1. sz. ügyfél rövidre ad el.

Az ügylet tárgy egy részvény, amelynek ISIN kódja XX000000002.

Y befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha az alábbiakat közli Z befektetési vállalkozással:

- 1) A pénzügyi eszköz azonosító kódját: a pénzügyi eszköz ISIN kódja XX000000002
- 2) Azt a tényt, hogy a megbízás a pénzügyi eszköz eladására szól
- 3) A megbízás szerinti árat és mennyiséget
- 4) Az eladó megjelölését: X befektetési vállalkozás jogalany-azonosítója. Ez azért van így, mert X befektetési vállalkozás nem továbbította ügyfelének (az 1. sz. ügyfélnek) az adatait Y

befektetési vállalkozáshoz. Ezért Y befektetési vállalkozás eladónak X befektetési vállalkozást, és nem 1. sz. ügyfelet tekinti.

- 5) A döntéshozó megjelölése és adatai: üresen maradnak
- 6) Short ügylet megjelölése: SELL (X befektetési vállalkozás nem rövidre ad el)
- 7) Annak megjelölését, hogy a továbbító félnél személy vagy algoritmus a felelős a befektetési döntésért: üresen marad (mivel a befektetési döntést a vállalkozáson kívül hozzák).
- 8) A befektetési döntést meghozó személyt felügyelő fióktelep országa: üresen marad (mivel a befektetési döntést a Y befektetési vállalkozáson kívül hozzák).
- 9) Az ügyféltől a megbízást átvevő Y befektetési vállalkozás fióktelepe szerinti ország: DE (mivel fióktelep nem vett részt az ügyletben, itt a vállalkozás központja szerinti ország két betűből álló országkódja áll, és mivel ebben az esetben a vállalkozás német, a mező a "DE" értéket mutatja).
- 10) A továbbító befektetési vállalkozást azonosító kód: Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosítója

Mivel X befektetési vállalkozás nem teljesíti a továbbítás feltételeit, neki is el kell küldenie saját ügyletjelentését.

Mivel Y befektetési vállalkozás teljesíti a továbbítás feltételeit, neki nem kell ügyletjelentést küldenie.

Mi legyen X és Z befektetési vállalkozás jelentésének tartalma?

N	Mező	Z befektetési vállalkozás 1. értékközlése	Z befektetési vállalkozás 2. értékközlése	X befektetési vállalkozás 1. értékközlése
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'		
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja
17	A fióktelep helye szerinti ország az eladó esetében		'DE'	'FR'
18	Eladó utóneve(i)			'JEAN'

19	Eladó vezetőneve(i)			'COCTEAU'
20	Eladó – születési dátum			1962. 06. 04.
21	Eladási döntéshozó kódja			1. sz. képviselő {NATIONAL_ID}-ja
22	Eladási döntéshozó – valamennyi utónév			'FABIO'
23	Eladási döntéshozó – valamennyi vezetőnév			'LUCA'
24	Eladási döntéshozó – születési dátum			1974. 10. 11.
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'true' (igaz)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában			
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában		Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-01T13:40:23.467Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'AOTC'
33	Árfolyam	'32,5'	'32,5'	'32,5'
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	XOFF	XOFF
41	Eszközazonosító kód	Instrumentum {ISIN} száma	Instrumentum {ISIN} száma	Instrumentum {ISIN} száma
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	5. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja		
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország	'GB'		
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	6. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	6. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'CY'	'CY'	'GB'
62	Short ügylet megjelölése	'SELL'	'SELL'	'SESH'

XML-beli ábrázolás:

Z befektetési vállalkozás 1. jelentése Piaci oldal	Z befektetési vállalkozás 2. jelentése Ügyfél oldal	X befektetési vállalkozás 1. jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888 88888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>111111111111111111 1</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>8888888888888888 8</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsm ssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888 8888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>8888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> <CtryOfBrnc>DE</CtryOfBrnc h> </AcctOwnc> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> <TrnsmttgSellr>ABCDEFGHIJK LMNOPQRST</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCT E</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnc>FR</CtryOfBrnc h> </AcctOwnc> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10- 11</BirthDt> <Othr> </pre>

<pre> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>1234</TradPlcMtgId> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>CY</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>CY</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> ... <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000002</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </pre>
---	--	---

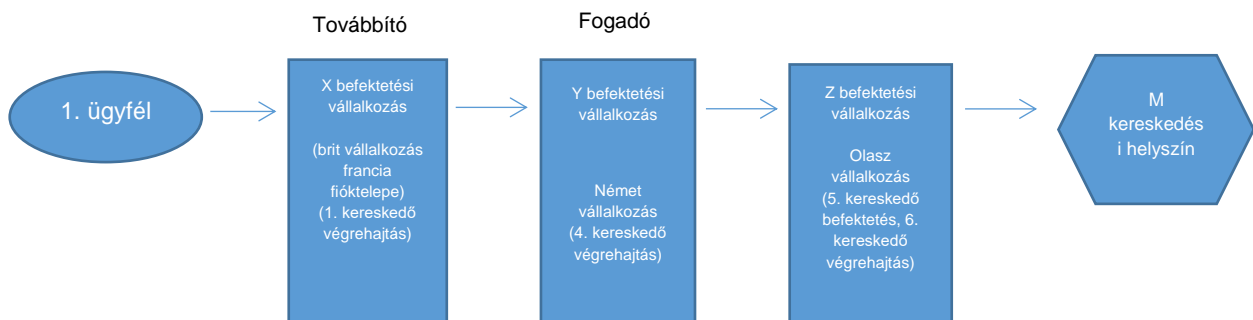
		</Tx>
--	--	-------

"A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában" (27. mező) a Z befektetési vállalkozás ügyletjelentésében nem X, hanem Y befektetési vállalkozás (mert X befektetési vállalkozás nem továbbított), Y befektetési vállalkozás pedig jelezte Z befektetési vállalkozásnak, hogy a neki küldött megbízást ő maga X befektetési vállalkozás nevében eljárva továbbította.

A 2. (ügyfél oldali) jelentésben az 57. és az 58. mező az Y befektetési vállalkozás által az adatszolgáltatást végző Z befektetési vállalkozásnak szolgáltatott információt mutassa. Mindkét mező üresen marad, mert a döntést az ügyfél hozta. Ezzel szemben az 59. és a 60. mezőt ki kell tölteni Z befektetési vállalkozás saját adataival, ezért fel kell tüntetni a Z befektetési vállalkozás ciprusi fióktelepe által felügyelt 6. sz. kereskedőt is³².

5.26.4.2 Továbbító és fogadó vállalkozásként egyszerre eljáró, a továbbítási feltételeit nem teljesítő befektetési vállalkozás

74. példa



1. sz. ügyfél X befektetési vállalkozás ügyfele. X befektetési vállalkozás francia fióktelepénél az 1. sz. kereskedő 1. sz. ügyféltől kapott diszkrecionális megbízása alapján a német illetőségű Y befektetési vállalkozásnak pénzügyi eszközök eladására ad megbízást. 1. sz. kereskedő X vállalkozás brit központjának a felügyelete alá tartozik. 4. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja X vállalkozás megbízását, és elhatározza, hogy azt Z vállalkozásnak küldi meg. Az olasz illetőségű Z befektetési vállalkozás nevében eljáró 5. sz. kereskedő úgy dönt, elfogadja Y befektetési vállalkozás megbízását, majd azt 6. sz. kereskedő elküldi M kereskedési helyszínre.

A megbízást ezután Z befektetési vállalkozás M kereskedési helyszín ajánlati könyvében 2018. július 1-én 13:40:23.4672-kor 32,50 euró árfolyamon teljesíti. A kereskedési helyszín az ügylet az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli.

X befektetési vállalkozás továbbítja a többi alábbi információval együtt 1. sz. ügyfél adatait Y befektetési vállalkozásnak, és megfelel a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításra vonatkozóan írt egyéb feltételeknek is.

³² Bár érdemes megjegyezni, hogy amennyiben az ügyfél hozná a döntést, a mezőben a 'NORE' érték szerepelne (lásd 5.12. bekezdés).

Y befektetési vállalkozás úgy dönt, nem ad át adatokat Z befektetési vállalkozásnak. Y befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik.

Az ügylet tárgya árualapú származtatott termék, amelynek ISIN kódja XX000000003, és 1. sz. ügyfél a 2014/65/EU irányelv 57. cikkének megfelelően nem csökkenti objektíven mérhető módon a kockázatát.

X befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha az alábbiakat közli Y befektetési vállalkozással:

- 1) A termék azonosító kódját; a termék ISIN kódja (XX000000003)
- 2) Azt a tény, hogy a megbízás a pénzügyi eszköz eladására szól
- 3) A megbízás szerinti árat és mennyiséget
- 4) Az eladó megjelölését: 1. sz. ügyfél nemzeti azonosítója
- 5) 1. sz. ügyfél adatait:
 - a) Vezeték- és utónév/neveket
 - b) A születési dátumot
- 6) A döntéshozó megjelölését és adatait: X befektetési vállalkozás jogalany-azonosítóját
- 7) A továbbító befektetési vállalkozáson belül a befektetési döntésért felelős személy vagy algoritmus azonosítását szolgáló megjelölést (X befektetési vállalkozás): 1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
- 8) A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti országot: GB
- 9) Az ügyféltől a megbízást átvevő X befektetési vállalkozás fióktelepe szerinti országot: FR
- 10) A továbbító vállalkozást azonosító kódot: X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
- 11) Árualapú származtatott termék megjelölését: 'false' (hamis)

Mivel Y befektetési vállalkozás nem adja tovább az összes adatot, neki is el kell küldenie saját ügyletjelentését.

Mivel X befektetési vállalkozás teljesíti a továbbításnak a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeit, ezért nem szükséges ügyletjelentést készítenie.

N	Mező	Z befektetési vállalkozás 1. értékközlése	Z befektetési vállalkozás 2. értékközlése	Y befektetési vállalkozás 1. értékközlése
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'		
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja

17	A fióktelep helye szerinti ország az eladó esetében		'IT'	'FR'
18	Eladó utóneve(i)			'JEAN'
19	Eladó vezetékeve(i)			'COCTEAU'
20	Eladó – születési dátum			1962. 06. 04.
21	Eladási döntéshozó kódja			X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
22	Eladási döntéshozó – valamennyi utónév			
23	Eladási döntéshozó – valamennyi vezetéknév			
24	Eladási döntéshozó – születési dátum			
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'true' (igaz)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában			
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában			X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-01T13:40:23.467Z'	'2018-07-01T13:40:23.467Z'	'2018-07-01T13:40:23Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'AOTC'
33	Árfolyam	'32,5'	'32.5'	'32,5'
34	Az ár pénzneme	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'
41	Eszközazonosító kód	Instrumentum {ISIN} száma	Instrumentum {ISIN} száma	Instrumentum {ISIN} száma
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	5. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	5. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős	'IT'	'IT'	'GB'

	fióktelep helye szerinti ország			
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	6. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	6. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'IT'	'IT'	'DE'
64	Árualapú származtatott termék megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)

XML-beli ábrázolás:

Z befektetési vállalkozás 1. jelentése Piaci oldal	Z befektetési vállalkozás 2. jelentése Ügyfél oldal	Y befektetési vállalkozás 1. jelentése
<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>8888888888888888 88888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>8888888888888888 88888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQR</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </pre>

<pre> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>1234</Trad PlcMtgId> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000003</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch > <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch > <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JON ES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000003</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch > <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch > <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JON ES</Id> </Othr> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</Trnsmssn Ind> <TrnsmtgSellr>123456789012 34567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000003</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnc h> <Othr> <Id>CA1112223334445555</I d> </Othr> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnc h> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> </pre>
--	---	---

		<pre> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>>false</RskRdcg Tx> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	--	---

Y befektetési vállalkozás egyszerre jár el, mint fogadó befektetési vállalkozás (azaz információt vesz át X befektetési vállalkozástól, ahol a továbbítási feltételek teljesülnek), és mint továbbító befektetési vállalkozás, amely a továbbítás feltételeit szintén nem teljesíti. E minőségében Y befektetési vállalkozásnak ügyletjelentési kötelezettsége van. Y befektetési vállalkozás ezért akkor jár el helyesen, ha a 25. mezőt kitöltve jelzi, hogy a továbbítás feltételeit nem teljesítve továbbít, és kitölti a 27. mezőt is annak jelzésére, hogy információt vett át X befektetési vállalkozástól, aki Y befektetési vállalkozás vonatkozásában teljesítette a továbbítás feltételeit. Emellett a 17. mezőben az X befektetési vállalkozástól átvett információt szerepelteti, azért ott nem a fogadó, hanem a továbbító befektetési vállalkozás fióktelepét tünteti fel.

5.26.4.3 A vállalkozás megbízásokat összesít, és egyes megbízások esetében igen, más megbízásoknál viszont nem teljesíti a továbbítás feltételeit.

75. példa

X befektetési vállalkozás két ügyfele, A és B ügyfél 100 illetve 200 eszköz eladására ad megbízást.

X befektetési vállalkozás a megbízásokat Y befektetési vállalkozásnak továbbítja. Csak X befektetési vállalkozás teljesíti a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt továbbítási feltételeket. Y befektetési vállalkozás 25,54 euró árfolyamon 2018. október 28-án 11:23:45.1243-kor M kereskedési helyszínen hajta végre 300 db eszközre szóló megbízást. X és Y befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	

16	Az eladó azonosító kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10- 28T11:23:45Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'true' (igaz)	
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-10-28T11:23:45Z'	
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	
30	Mennyiség	'200'	
33	Árfolyam	'25,54'	
36	Helyszín	'XOFF'	

Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'
16	Az eladó azonosító kódja	'INTC'	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)
26	A továbbító vállalkozás azonosító			

	kódja a vevő vonatkozásában			
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában		X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-10-28T11:23:45.124Z'	'2018-10-28T11:23:45.124Z'	'2018-10-28T11:23:45.124Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'300'	'100'	'200'
33	Árfolyam	'25,54'	'25,54'	'25,54'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

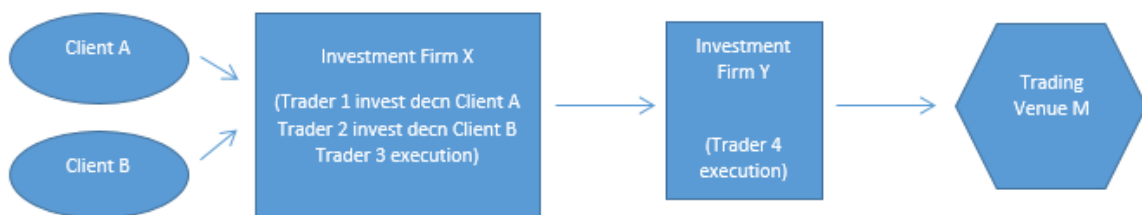
értékközlés	2. jelentés	3. jelentés
<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgSellr>123456789012 34567890</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> </pre>

<pre> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </pre>
---	---	---

5.27 Több ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozás

5.27.1 Több ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozás, amely nem teljesíti a továbbítás feltételeit (összesített megbízások és láncok/átadás kombinációja)

76. példa



Client A	A ügyfél
Client B	B ügyfél
Investment Firm X	X befektetési vállalkozás
(Trader 1 invest decn Client A Trader 1 invest decn Client B Trader 3 execution)	(1. kereskedő befektetési döntés A ügyfél 1. kereskedő befektetési döntés B ügyfél 3. kereskedő végrehajtás)
Investment Firm Y	Y befektetési vállalkozás

(Trader 3 execution)	(3. kereskedő végrehajtás)
Trading Venue M	M kereskedési helyszín

X befektetési vállalkozás A és B ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján jár el. 1. sz. kereskedő úgy dönt, A ügyfél nevében egy adott pénzügyi eszközből 400 egységet elad. 2. sz. kereskedő úgy dönt, ugyanebből a pénzügyi eszközből B ügyfél számára 200 egységet vesz. 3. sz. kereskedő az összesített megbízást Y befektetési vállalkozásnak küldi meg teljesítésre. A megbízást végül 4. sz. kereskedő M kereskedési helyszínen két részletben teljesíti, az egyiket, amelyben 350 eszközt forgalmaz 30 euró árfolyamon, 2018. június 24-én 14:25:30.1264-kor hajtja végre, a másikat 250 egységet tartalmazó ügyletet pedig 2018. június 24-én 15:55:40.3452-kor teljesíti 32,5 euró árfolyamon. A kereskedési helyszín az ügyletekhez az '1234'-es és a '6789'-os ügyletazonosító kódot rendeli.

Ha viszont X befektetési vállalkozás alapkezelő lenne és nem befektetési vállalkozás, Y befektetési vállalkozásnak az alapkezelőt kellene vevőként/eladóként megjelölni, a döntéshozóra vonatkozó mezőket viszont nem kellene kitölteni, mert a befektetési vállalkozásnak nem minősülő alapkezelőnek nincs ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége, és nem is továbbíthat megbízást.

X befektetési vállalkozás ügyletjelentésének módja attól függ, hogyan igazolja neki vissza Y befektetési vállalkozás a végrehajtott ügyleteket. ezt mutatjuk be alább.

Hasonlóképpen, X befektetési vállalkozás által az ügyletek végrehajtásáról küldött visszaigazolásától függ, hogy A és B ügyfél hogyan készítené el a jelentését, ha befektetési vállalkozásnak minősülne.

X befektetési vállalkozás nem felel meg a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításról írt feltételeknek.

X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik.

5.27.1.1 Y befektetési vállalkozás mindkét piaci oldali végrehajtást visszaigazolja X befektetési vállalkozásnak

Erre akkor kerül sor, amikor a végrehajtó bróker "egyéb szerepben" jár el vagy saját kitétség nélküli ügyletpárosítást végez.

Y befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik.

77. példa

A forgatókönyv ugyanaz, mint az 5.27.1. bekezdésben bemutatott példa esetében, ahol Y végrehajtó bróker a piaci végrehajtásokat rendre visszaigazolja a X befektetési vállalkozásnak.

X befektetési vállalkozásnak ügyletjelentési kötelezettsége van, mert nem felel meg a továbbítási feltételeknek.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékek 1. jelentés X befektetési vállalkozás	Értékek 2. jelentés X befektetési vállalkozás	Értékek 3. jelentés X befektetési vállalkozás	Értékek 4. jelentés X befektetési vállalkozás	Értékek 1. jelentés Y befektetési vállalkozás	Értékek 2. jelentés Y befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja					'1234'	'6789'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	'INTC'	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
12	Vételi döntéshozó kódja			X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja		
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'	M kereskedési helyszíne ez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszíne ez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja

21	Eladási döntéshozó kódja						
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'true' (igaz)	'true' (igaz)	'true' (igaz)	'true' (igaz)	'false' (hamis)	'false' (hamis)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában						
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában						
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T14:25:30Z'	'2018-06-24T15:55:40Z'	'2018-06-24T14:25:30Z'	'2018-06-24T14:25:30Z'	'2018-06-24T14:25:30.126Z'	'2018-06-24T15:55:40.345Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'350'	'250'	'400'	'200'	350	250
33	Árfolyam	'30'	'32,5'	'31,0416667'	'31,0416667'	30	32,5
34	Az ár pénzneme	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'	EUR	EUR
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	M kereskedési helyszín szegmens azonosító {MIC} kódja	M kereskedési helyszín szegmens azonosító {MIC} kódja
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés			1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja		
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	3. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	3. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	3. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	3. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. sz. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. sz. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

Figyelmet érdemel, hogy X befektetési vállalkozás 3. és 4. jelentésében a 12. mező X befektetési vállalkozást azonosítja, mert X befektetési vállalkozás diszkrecionális alapon jár el A és B ügyfél nevében. Az A és B ügyfél nevében döntést hozó kereskedőket azonosító adatok az 57. mezőben szerepelnek.

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás 1. jelentése	X befektetési vállalkozás 2. jelentése	X befektetési vállalkozás 3. jelentése	X befektetési vállalkozás 4. jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</T rnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 06- 24T14:25:30Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</T rnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 06- 24T15:55:40Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="EUR">32.5</Am t> </MntryVal> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>1234567890123 4567890</LEI> </DcsnMakr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> <Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</T rnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 06- 24T14:25:30Z</TradDt > <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678 901234567890</Exct gPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>123456789012 34567890</LEI> </DcsnMakr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> <Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</ TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018- 06- 24T14:25:30Z</TradD t> <TradgCpcty>AOTC< /TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> </pre>

<pre> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> ... <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> ... <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Amt Ccy="EUR">31.041667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Amt Ccy="EUR">31.041667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	---	--

Y befektetési vállalkozás 1. jelentése	Y befektetési vállalkozás 2. jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> </pre>

<pre> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30.126Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:40.345Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>6789</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

X befektetési vállalkozás az ügyfél allokációk mellett az Y befektetési vállalkozással kötött ügylet piaci oldalát jelenti.

X befektetési vállalkozás bejelenti az Y befektetési vállalkozás által neki visszaigazolt és az 'INTC' összesített ügyfélszámlára beérkező összes ügyletet, majd bejelenti az összesített számláról az ügyletek felé irányuló mozgásokat is.

Ha Y befektetési vállalkozás saját kitétség nélküli ügyletpárosítást végezne, azonos jelentéseket készítené azzal a kivétellel, hogy a jelentéseiben a kereskedési szerepre vonatkozó 29. mezőben a 'MTCH' értéket tüntetné fel.

5.27.1.2 Y befektetési vállalkozás visszaigazolja a teljesült ügyletet X befektetési vállalkozásnak

Erre akkor kell sort keríteni, amikor Y végrehajtó bróker saját számlára kereskedik.

78. példa

A forgatókönyv ugyanaz, mint a fenti 5.27.1 bekezdésben bemutatott példa esetében azzal az eltéréssel, hogy Y befektetési vállalkozás nem a piaci végrehajtásokat, hanem a teljesített ügyleteket igazolja vissza X befektetési vállalkozásnak. Az időpont a második végrehajtás időpontja vagy annál későbbi legyen, hogy tükrözze, mikor történt Y befektetési vállalkozás felé az allokáció. Például, Y visszaigazolja X befektetési vállalkozásnak, hogy 600 részvényt vett 31,0416667 árfolyamon 2018.06.24-én 16:06:20.34-kor.

X befektetési vállalkozásnak ügyletjelentési kötelezettsége van, mert nem felel meg a továbbítási feltételeknek.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés X befektetési vállalkozás	2. értékközlés X befektetési vállalkozás	3. értékközlés X befektetési vállalkozás	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	2. értékközlés Y befektetési vállalkozás	3. értékközlés Y befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja				'1234'	'6789'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja

12	Vételi döntéshozó kódja		X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja			
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'	M kereskedési helyszính ez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszính ez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
21	Eladási döntéshozó kódja						
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'true' (igaz)	'true' (igaz)	'true' (igaz)	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában						
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában						
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T16:06:20Z'	'2018-06-24T16:06:20Z'	'2018-06-24T16:06:20Z'	'2018-06-24T14:25:30.126.Z'	'2018-06-24T15:55:40.345Z'	'2018-06-24T16:06:20Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	'600'	'400'	'200'	'350'	'250'	'600'
33	Árfolyam	'31,0416667'	'31,0416667'	'31,0416667'	'30'	'32,5'	'31,0416667'

34	Az ár pénzneme	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'	M. kereskedési helyszín szegmens azonosító {MIC} kódja	M. kereskedési helyszín szegmens azonosító {MIC} kódja	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	3. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	3. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	3. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés X befektetési vállalkozástól	2. jelentés X befektetési vállalkozástól	3. jelentés X befektetési vállalkozástól
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </Buyr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </Buyr> </pre>

<pre> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</Trnsmssnl nd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> > <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</Trnsmssn Ind> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>CA1112223334445555</ Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--

1. jelentés Y befektetési vállalkozástól	2. jelentés Y befektetési vállalkozástól	3. jelentés Y befektetési vállalkozástól
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T14:25:30.126.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPI cMtchgId> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:55:40.345Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpc ty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>6789</TradPI cMtchgId> </Tx> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPO QRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">31.0416667</A mt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> </pre>

<pre> <Prsn> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	---	--

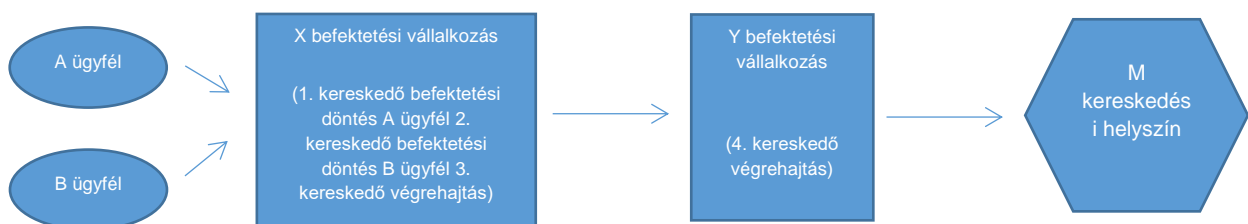
Akárcsak fentebb, az X befektetési vállalkozásnak az ügyfél allokációk mellett az Y befektetési vállalkozással kötött ügylet piaci oldalát kell jelentenie.

Mivel Y befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, X vállalkozásnak a teljesült összesített mennyiséget igazolja vissza, így X befektetési vállalkozás először az 'INTC' összesített számlára beérkező, összesített mennyiségre vonatkozó ügyletet jelenti, majd pedig az erről a számláról az ügyfelek felé irányuló mozgásokat.

Azt az esetet, amikor X befektetési vállalkozás megbízásokat összesít, és a továbbítás feltételeit csak bizonyos megbízások esetében teljesíti, mások esetében nem, lásd az 5.26.4.3. bekezdést.

5.27.2 A befektetéskezelő diszkrecionális megbízás alapján több ügyfél nevében jár el és teljesíti a továbbítás feltételeit

79. példa



1. sz. kereskedő, akit az 1. és 2. sz. ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró X befektetési vállalkozás felügyel, úgy dönt, 1. sz. ügyfél nevében 500 részvényt ad el, míg 2. sz. kereskedő, aki szintén X befektetési vállalkozás felügyelete alá tartozik, 2. sz. ügyfél nevében 200 részvény eladásáról határoz. Az X befektetési vállalkozás által felügyelt 3. sz. kereskedő a 700 részvényre szóló az összesített megbízást Y befektetési vállalkozásnak küldi meg. Az Y befektetési vállalkozás által felügyelt 4. sz. kereskedő elfogadja a megbízást, és M kereskedési helyszínen egyetlen végrehajtással 2018. június 24-én 13:20:52.1456-kot 21 eurós árfolyamon teljesíti.

X befektetési vállalkozás brit illetőségű, Y befektetési vállalkozás pedig olasz cég.

1. sz. ügyfél rövidre ad el, 2. sz. ügyfél nem. Y befektetési vállalkozás pozíciója a piaci eladás előtt semleges volt, ezért a piaci végrehajtás időpontjában rövidre ad el.

X befektetési vállalkozás továbbítja a többi információval együtt 1. és 2. sz. ügyfél adatait Y befektetési vállalkozásnak, és megfelel a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításra vonatkozóan írt egyéb feltételeknek.

X befektetési vállalkozás akkor jár el helyesen, ha az alábbiakat közli Y befektetési vállalkozással:

- 1) A pénzügyi eszköz azonosító kódját: az eszköz ISIN kódja
- 2) Azt a tényt, hogy a megbízás a pénzügyi eszköz eladására szól
- 3) A megbízás árfolyamát és mennyiségét: 700 részvény piaci árfolyama
- 4) A döntéshozó megjelölését és adatait: X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
- 5) A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti országot: GB
- 6) X befektetési vállalkozásnak a befektetési döntést hozó telephelye szerinti országot: GB
- 7) A továbbító vállalkozást azonosító kódot: X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja

X befektetési vállalkozás később (már a végrehajtás után, de a továbbítási megállapodásban megengedett időn belül) az alábbiakat közli:

- 8) 1. és 2. sz. ügyfélnek juttatott allokációkat
- 9) Az eladók megjelölését: 1. sz. ügyfél nemzeti azonosítója és 2. sz. ügyfél nemzeti azonosítója
- 10) 1. sz. ügyfél adatait:
 - a) Vezeték- és utónév/nevek
 - b) Születési dátum
- 11) 1. sz. ügyfél esetében a short ügylet megjelölését: SESH (1. sz. ügyfél rövidre ad el)
- 12) A vállalkozáson belül 1. sz. ügyfél befektetési döntéséért felelős személy vagy algoritmus azonosítását szolgáló megjelölést: 1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

13) 2. sz. ügyfél adatait

- a) Vezeték- és utónév/nevek
- b) Születési dátum

14) 2. sz. ügyfél esetében a short ügylet megjelölését: SELL (2. sz. ügyfél nem rövidre ad el)

15) A vállalkozáson belül 2. sz. ügyfél befektetési döntéséért felelős személy vagy algoritmus azonosítását szolgáló megjelölést: 2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

Y befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, és a "részvényeket ugyanazon a napon 15:00:12:51-kor átadja X befektetési vállalkozásnak.

Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	2. értékközlés Y befektetési vállalkozás	3. értékközlés Y befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'		
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
12	Vételi döntéshozó kódja			
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja	2. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja
18	Eladó utóneve(i)		'JEAN'	'JOSE, LUIS'
19	Eladó vezetéknéve(i)		'COCTEAU'	'RODRIGUEZ DE LA TORRE'
20	Eladó – születési dátum		1962. 06. 04.	1976. 02. 27.
21	Eladási döntéshozó kódja		X vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)

26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában			
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában		X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T13:20:52.1456Z'	'2018-06-24T15:00:12Z'	'2018-06-24T15:00:12Z'
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Mennyiség	700	500	200
33	Árfolyam	21	21	21
34	Az ár pénzneme	EUR	EUR	EUR
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország	'IT'	'GB'	'GB'
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'IT'	'IT'	'IT'
62	Short ügylet megjelölése	'SESH'	'SESH'	'SELL'

XML-beli ábrázolás:

Y befektetési vállalkozás 1. jelentése	Y befektetési vállalkozás 2. jelentése	Y befektetési vállalkozás 3. jelentése
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKL MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr></pre>

<pre> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQRST</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>700</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMchglId>1234</TradPlcMchglId> </Tx> ... <InvstMtdcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> > <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </pre>	<pre> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQRST</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE E</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnc> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </pre>	<pre> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNO PQRST</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> ... </Prsn> </Id> </AcctOwnc> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </pre>
--	--	--

<pre> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	--	---

Hogyan alakulna Y befektetési vállalkozás jelentése, ha a fentiek helyett inkább "egyéb szerepben" kereskedne?

N	Mező	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	2. értékközlés Y befektetési vállalkozás	3. értékközlés Y befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'		

4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'
12	Vételi döntéshozó kódja			
16	Az eladó azonosító kódja	'INTC'	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja	2. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja
18	Eladó utóneve(i)		'JEAN'	'JOSE, LUIS'
19	Eladó vezetéknéve(i)		'COCTEAU'	'RODRIGUEZ DE LA TORRE'
20	Eladó – születési dátum		1962. 06. 04.	1976. 02. 27.
21	Eladási döntéshozó kódja		X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában			
27	A továbbító vállalkozás azonosító kódja az eladó vonatkozásában		X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-06-24T13:20:52.1456Z'	'2018-06-24T13:20:52.1456Z'	'2018-06-24T13:20:52.1456Z'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
30	Mennyiség	'700'	'500'	'200'
33	Árfolyam	'21'	'21'	'21'
34	Az ár pénzneme	'EUR'	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'

57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország		'GB'	'GB'
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	4. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'IT'	'IT'	'IT'
62	Short ügylet megjelölése		'SESH'	'SELL'

XML-beli ábrázolás:

Y befektetési vállalkozás 1. jelentése	Y befektetési vállalkozás 2. jelentése	Y befektetési vállalkozás 3. jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmssn nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:00:12Z</TradDt> </Tx> </OrdTrnsmssn> </Buyr> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06- 04</BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCT E</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </Buyr> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02- 27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </AcctOwnr> </Sellr> </Buyr> </New> </Tx> </pre>

<pre> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>700</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtgId>1234</TradPl cMtgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>..</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> <TrnsmtgSellr>123456789012 34567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnc h> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id > <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> </pre>	<pre> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmss nInd> <TrnsmtgSellr>12345678901 234567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBr nch> <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrn ch> </pre>
--	--	---

	<pre> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch > <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSell gInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSel lgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
--	---	---

Ha Y befektetési vállalkozás saját kitettség nélküli ügyletpárosítást végezne, akkor a jelentése teljesen azonos lenne egy kivétellel, hogy a kereskedési szerep mezőbe a 'MTCH' értéket tüntetné fel.

5.28 Közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA)

Ügyletjelentést (a B. változatban említett kivétellel) a DEA-szolgáltatónak és a DEA-ügyfélnek is be kell nyújtania, ha befektetési vállalkozásként működik.

Amikor a DEA-szolgáltató ügyletjelentést készít, akkor jár el helyesen, ha végrehajtó szervezetként azonosítja magát (4. mező: "A végrehajtó szervezet azonosító kódja"). Amikor a DEA-ügyfél (az ügyfél) dönt, hogyan jár el, a DEA-szolgáltató a végrehajtást a vállalati mezőben 'NORE' megjegyzéssel tünteti fel, az **Error! Reference source not found.** részben szereplők alapján. A DEA-szolgáltató soha ne töltsse ki az 57. mezőt ("A vállalkozáson belüli befektetési döntés"), mert soha nem vesz részt a befektetési döntésben, amely a DEA-ügyfél feladata. Emellett a DEA-szolgáltató jelentését AOTC vagy MTCH kereskedési szerepben (29. mező) készítse el.

Ügyletjelentésében a DEA-ügyfél a DEA-szolgáltatót, és ne a piacot azonosítsa értelemszerűen vevőként (7. mező: "A vevő azonosító kódja") vagy eladóként (16. mező: "Az eladó azonosító kódja"). Ugyanakkor a 36. mezőben ("Helyszín") mindig az 'XOFF' értéket szerepeltesse, mert nem a piaccal szemben álló szervezet. Ugyanakkor hangsúlyt érdemel, hogy amikor a DEA-ügyfél egy ügyfél nevében jár el, és amikor ennek az ügyfélnek az adatait adja meg a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételek alapján, akkor a DEA-ügyfélnek nem kell ügyletjelentést készítenie, mert az illetékes hatóság az ügyletre vonatkozó összes információról értesül a DEA-szolgáltató ügyletjelentéséből.

5.28.1 forgatókönyv: a DEA-ügyfél saját számlára kereskedik mögöttes ügyfél nélkül

80. példa

X befektetési vállalkozás (a DEA-ügyfél) Y befektetési vállalkozás (a DEA-szolgáltató) tagsági kódját használva nyújt be ajánlatot M kereskedési helyszínen. X befektetési vállalkozás ajánlata pénzügyi eszközök vételére szól M kereskedési helyszínen. X befektetési vállalkozáson belül 1. sz. kereskedő hozta a befektetési döntést, 2. sz. kereskedőnek pedig az a feladata, hogy az ajánlatot az Y befektetési vállalkozás által biztosított DEA-rendszeren benyújtsa. M kereskedési helyszín az '1234' kódot hozza létre a kereskedési helyszín azonosító kódjaként (TVTIC).

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	2. értékközlés X befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
12	Vételi döntéshozó kódja		
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
21	Eladási döntéshozó kódja		
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'false' (hamis)
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'DEAL'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	'NORE'	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

XML-beli ábrázolás:

Y befektetési vállalkozás 1. jelentése (DEA-szolgáltató)	X befektetési vállalkozás 1. jelentése (DEA-ügyfél)
<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty></pre>	<pre><Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty></pre>

<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

A forgatókönyv szerint X befektetési vállalkozáson belül nem ugyanaz a kereskedő hozza meg a befektetési döntést, mint aki az ajánlatot végrehajtásra benyújtja. Ha X befektetési vállalkozáson belül egyetlen kereskedő felelne a befektetési döntés meghozataláért és a végrehajtásért, akkor X

vállalkozás jelentésében az 57. és az 59. mezőnek is az adott kereskedő nemzeti azonosítóját kellene mutatnia.

5.28.2 2. forgatókönyv: DEA-ügyfél egy ügyfél nevében jár el.

5.28.2.1 A változat: A DEA-szolgáltatónak nem továbbítják az ügyfél adatait

81. példa

X befektetési vállalkozás (a DEA-ügyfél) Y befektetési vállalkozás (a DEA-szolgáltató) tagsági kódját használva nyújt be ajánlatot M kereskedési helyszínen. X befektetési vállalkozás ajánlata pénzügyi eszközök vételére szól M kereskedési helyszínen. X befektetési vállalkozás 1. sz. ügyfél nevében jár el, akinek az adatait nem továbbítja Y befektetési vállalkozásnak. A befektetési döntést 1. sz. ügyfél hozta. X befektetési vállalkozáson belül 1. sz. kereskedő feladata, hogy az ajánlatot az Y befektetési vállalkozás által biztosított DEA-rendszeren benyújtsa. M kereskedési helyszín az 1234 TVTIC kódot generálja.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	1. értékközlés X befektetési vállalkozás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} vállalkozás
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja
12	Vételi döntéshozó kódja		
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
21	Eladási döntéshozó kódja		
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	'true' (igaz)
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	'NORE'	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja

XML-beli ábrázolás:

Y befektetési vállalkozás 1. jelentése (DEA-szolgáltató)	X befektetési vállalkozás 2. jelentése (DEA-ügyfél)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>

5.28.2.2 A. változat: Az ügyfél adatait továbbítják a DEA-szolgáltatónak

82. példa

X befektetési vállalkozás (a DEA-ügyfél) Y befektetési vállalkozás (a DEA-szolgáltató) tagsági kódját használva nyújt be ajánlatot M kereskedési helyszínen. X befektetési vállalkozás ajánlata pénzügyi eszközök vételére szól M kereskedési helyszínen. X befektetési vállalkozás 1. sz. ügyfél nevében jár el, akinek az adatait a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikke szerint továbbítja Y befektetési vállalkozásnak. M kereskedési helyszín az 1234 TVTIC kódot generálja. Mivel X befektetési vállalkozás teljesíti a továbbításnak a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeit, ezért nem szükséges ügyletjelentést készítenie.

Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

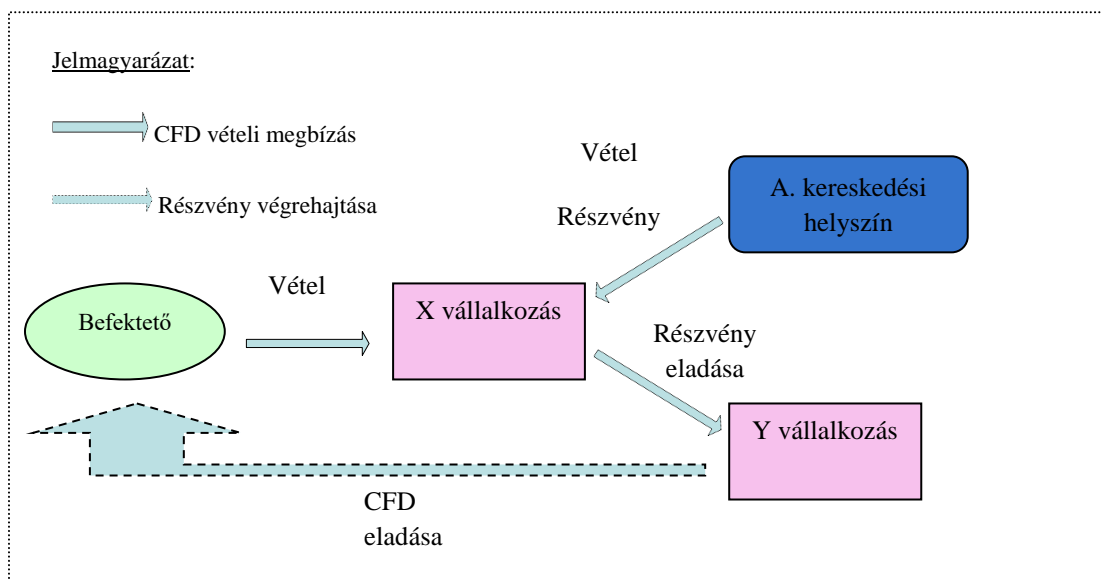
N	Mező	Értékközlés Y befektetési vállalkozás	XML-beli ábrázolás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	<Tx> <New>
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja	... <Buyr> <AcctOwnc> <Prsn>
12	Vételi döntéshozó kódja		...
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Othr>
21	Eladási döntéshozó kódja		<Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr>
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	</Prsn> </Id> </AcctOwnc>
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <AcctOwnc> <Prsn> <Id>
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	<LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnc>
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	</Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id>

57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		</OrdrTrnsmssn> <Tx>
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország		... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn>
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	'NORE'	<TradPlcMtchglId>1234</TradPlcMtchglId> </Tx>
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa		<ExctgPrsn> <CInt>NORE</CInt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

5.29 Pozíció fedezése különbözeti ügylettel (CFD)

83. példa

1. sz. ügyfél konkrét részvény alaptermékre szóló különbözeti ügyletre (CFD) ad megbízást X befektetési vállalkozásnak. Az alapul szolgáló részvény ISIN kódja GB00BH4HKS39. X befektetési vállalkozás (a fedezet biztosítása érdekében) M kereskedési helyszínen megveszi a részvényt, majd továbbítja ezt az ügyletet (eladja a részvényt) Y befektetési vállalkozásnak (kiemelt brókerének), aki közvetlenül 1. sz. ügyféllel köt CFD kontraktust. X és Y befektetési vállalkozás egyaránt saját számlára kereskedik.



Ebben a forgatókönyvben X és Y befektetési vállalkozásnak egyaránt van ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége, mert mind a ketten végrehajtottak ügyleteket: X befektetési vállalkozás megvette és eladta a részvényt, Y befektetési vállalkozás pedig megvette a részvényt, és eladta 1. sz. ügyfélnek a CFD-t.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés X befektetési vállalkozás	2. értékközlés X befektetési vállalkozás	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	2. értékközlés Y befektetési vállalkozás ³³
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID}-ja
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'	'XXXX'
41	Eszközazonosító kód	Vodafone részvények {ISIN} száma	Vodafone részvények {ISIN} száma	Vodafone részvények {ISIN} száma	
42	Eszköz teljes neve				'VODAFONE CFD'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás 1. jelentése	X befektetési vállalkozás 2. jelentése	Y befektetési vállalkozás 1. jelentése	Y befektetési vállalkozás 2. jelentése
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEF

³³ A CFD instrumentumok bejelentésének módjáról további információ az 5.35.4. bekezdésben olvasható.

<pre> <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>111111111111111 111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</T radgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradV n> ... </Tx> ... <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</ Id> </FinInstrm> </New> </Tx> </pre>	<pre> <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</T radgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Trad Vn> ... </Tx> <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</ Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <ExctgPty>ABCDEF GHIJKLMNOPQRST </ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>123456789012 34567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</ TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Tra dVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39 </Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> GHIJKLMNOPQRST </ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19620604JEA N#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prt ry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL< /TradgCpcty> ... <TradVn>XXXX</Tra dVn> </Tx> <FinInstrm> <FinInstrmGnlAttrbts > <FullNm>VODAFON E CFD</FullNm> ... </FinInstrmGnlAttrbts > ... </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	---	--	--

Y befektetési vállalkozás 2. jelentése az eszközről egyéb referenciaadatokat is tartalmaz, amelyek a fenti táblázatból kimaradtak. Az OTC CFD ügyletek bejelentését lásd az iránymutatások IV. részében.

5.30 A kereskedési helyszínek MiFIR 26. cikk (5) bekezdés szerinti ügyletjelentési kötelezettsége a saját rendszereiken keresztül teljesített ügyletekre vonatkozóan

A MiFIR 26. cikk (5) bekezdése alapján a kereskedési helyszínek ügyletjelentést kötelesek benyújtani a platformjukon kereskedett pénzügyi eszközökben létrejött, és a rendszereiken keresztül olyan vállalkozások által végrehajtott ügyletekről, amelyekre nem terjed ki a MiFIR hatálya.

A kereskedési helyszínen köteles mindazokat a mezőket kitölteni, amelyeket a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletének 2. táblázata szerint a vállalkozásnak is be kellene jelentenie, ha a MiFIR hatálya kiterjedne rá, ideértve a cégen belüli befektetési döntés és a cégen belüli végrehajtás megjelölését, a mentességeket és a jelölő címkéket valamint adott esetben az ügyfél azonosításának megjelölését. Ahol a vállalkozás saját számlára kereskedik, ezeket az adatokat a vállalkozás szempontjából helyes feltüntetni. Ahol a vállalkozás az ügyfél nevében saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez vagy egyéb szerepben kereskedik, a kereskedési helyszínen szerepeltessen további adatokat a 8-15. mezőkben (ha az ügyfél a vevő) illetve a 17-24. mezőkben (ha az ügyfél elad), és adott esetben jelölje meg, hogy az ügyfél short ügyletet hajt végre, és tüntesse fel az árualapú származtatott termék megjelölését is. A short ügylet és az árualapú származtatott termék megjelölése mezőket az ügyfél szempontjából helyes kitölteni. A végrehajtó szervezet (4. mező) és a hozzá tartozó ügyfél (7. és 16. mező) azonosítása tekintetében a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 5. cikkében és a 13. cikk (3) bekezdésében valamint a MiFIR 26.6 cikkében írt rendelkezéseket kell alkalmazni, amennyiben azok jogalany-azonosító kódra jogosultak. A jogalany-azonosító kódra nem jogosult ügyfelek esetében a kereskedési helyszínen akkor jár el helyesen, ha ellenőrzi, hogy a megadott nemzeti azonosító nem tartalmaz-e nyilvánvaló hibákat, illetve teljes-e.

5.30.1 A vállalkozás saját számlára kereskedik

84. példa

A befektetési vállalkozásnak nem minősülő R vállalkozás M kereskedési helyszínen ügyfele számára pénzügyi eszközöket vesz. R vállalkozás jogalany-azonosító kódja 'RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR'. A kereskedési helyszínen üzemeltetőjének a jogalany-azonosító kódja 'TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV'. A kereskedési helyszínen az ügyletjelentéshez az '55555555' kereskedési helyszínen azonosító kódot és a '6868689' ügylet hivatkozási számot hozza létre.

Hogyan készítse el M kereskedési helyszínen a jelentését?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
2	Az ügylet referenciaszáma	'6868689'	<Tx> <New>
3	A kereskedési helyszínen ügyletazonosító kódja	'55555555'	... <TxId>6868689</TxId>
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> ...

5	A 2014/65/EU irányelv hatálya alá tartozó befektetési vállalkozás	'false' (hamis)	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglId>55555555</TradPlcMtchglId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	
7	A vevő azonosító kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	

Az eszközre vonatkozó mezőket a IV. részben bemutatott módon tanácsos kitölteni.

Ha a vállalkozás egy ügyféllel ehhez kapcsolódó OTC ügyletet köt, azt a kereskedési helyszín nem köteles bejelenteni, mert annak a végrehajtása nem a kereskedési rendszerein keresztül történik.

5.30.2 Egyetlen ügyfél számára "saját kitétség nélkül ügyletpárosítást" végző vagy "egyéb szerepben" kereskedő vállalkozás

85. példa

A befektetési vállalkozásnak nem minősülő R vállalkozás egyik ügyfele, azaz S vállalkozás részére M kereskedési helyszín ajánlati könyvében keresztül részvényeket vesz, ám S vállalkozás is ügyfél nevében (T ügyfél) jár el. R vállalkozás jogalany-azonosító kódja 'RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR'. S vállalkozás jogalany-azonosító kódja 'SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS'. A kereskedési helyszín üzemeltetőjének a jogalany-azonosító kódja 'TVT VTVTVTVTVTVTVTVTVT'. A kereskedési helyszín az ügyletjelentéshez az '55555555' kereskedési helyszín azonosító kódot és a '6868689' ügylet hivatkozási számot hozza létre.

Ha R vállalkozás "egyéb szerepben" jár el, akkor a kereskedési helyszín az alábbiak szerint készíti el a jelentését:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
2	Az ügylet referenciaszáma	'6868689'	<Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId>
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'55555555'	<ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd>
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>
5	A 2014/65/EU irányelv hatálya alá tartozó befektetési vállalkozás	'false' (hamis)	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	M kereskedési helyszín üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Tx> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId> </Tx>
7	A vevő azonosító kódja	S vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Tx> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId> </Tx>
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <New> </Tx>
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	

Az eszközre vonatkozó mezőket a IV. részben bemutatott módon tanácsos kitölteni.

Mivel R vállalkozás "egyéb szerepben" kereskedik, a kereskedési helyszín által benyújtott ügyletjelentésnek a közvetlenül mögötte álló ügyletet (S ügyletet) kell azonosítania, T ügyletet azonban nem.

Ha R vállalkozás saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végezne, az ügyletjelentés teljesen azonos lenne azzal a különbséggel, hogy a kereskedési szerep mezőben a 'MTCH' érték állna.

5.30.3 Több ügyfél megbízását összesítő vállalkozás

Ahol a vállalkozás több ügyfél megbízását összesíti adott kereskedési helyszínen, és "egyéb szerepben" jár el, vagy saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végez, a kereskedési helyszín akkor jár el helyesen, ha az összes ügyfél adatait bejelenti. Ez azt jelenti, hogy a 8-15. mezőben a vevő, és az ennek megfelelő mezőkben az eladó további adatai is szerepelni fognak a jelentésben adott esetben az ügyfélre vonatkozóan a short ügylet és az árualapú származtatott termék megjelölése mellett.

86. példa

A nem befektetési vállalkozásnak minősülő A vállalkozás M kereskedési helyszín ajánlati könyvében keresztül három ügyfél, A, B és C ügyfél számára részvényeket vesz. R vállalkozás "egyéb szerepben" jár el. A kereskedési helyszín üzemeltetőjének a jogalany-azonosító kódja 'TVT(VT)VTVT(VT)VTVT(VT)V'. A kereskedési helyszín az '55555555' kereskedési helyszín-azonosító kódot, a piaci ügyletjelentéshez a '6868689' ügylet hivatkozási számot, az ügyfélallokációkhoz pedig a '6868690', '6868691' és '6868692' kódokat hozza létre.

Hogyan készítse el M kereskedési helyszínt a jelentését?

N	Mező	1. értékközlés X befektetési vállalkozás	2. értékközlés X befektetési vállalkozás	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	2. értékközlés Y befektetési vállalkozás
2	Az ügylet referenciaszáma	'6868689'	'6868690'	'6868691'	'6868692'
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'55555555'			
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
5	A 2014/65/EU irányelv hatálya alá tartozó befektetési vállalkozás	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)	'false' (hamis)
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	M kereskedési helyszín üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszín üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszín üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszín üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja

7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	C ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'	'INTC'
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'	'AOTC'
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'

XML-beli ábrázolás:

M kereskedési helyszín 1. jelentése	M kereskedési helyszín 2. jelentése	M kereskedési helyszín 3. jelentése	M kereskedési helyszín 4. jelentése
<pre> <Tx> <New> <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR</ ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</I nvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDTV TVTDTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111 11111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868690</TxId> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR</ ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</I nvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDTV TVTDTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868691</TxId> > <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR R</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false </InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDT VTDTVTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868692</TxI d> <ExctgPty>RRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR R</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false </InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTDT VTDTVTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCC CCCCCCCCCC</L EI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </pre>

<pre> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradV n> <TradPlcMtchgId>5555 5555</TradPlcMtchgId > </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</ TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Trad Vn> </Tx> </New> </Tx> </pre>	<pre> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC< /TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> ... </New> </Tx>> </pre>	<pre> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC< /TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</Tra dVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	---	---

Ha R vállalkozás saját kitétség nélkül ügyletpárosítást végezne, az ügyletjelentés teljesen azonos lenne azzal a különbséggel, hogy a kereskedési szerep mezőben a 'MTCH' érték állna.

5.31 Értékpapír-finanszírozási ügyletek

Az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatszolgáltatási kötelezettség általános leírása az 5.6.2. bekezdés tárgyi albekezdése tartalmazza (kivételek a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (5) bekezdés a) pontja alapján).

87. példa

CB központi bank (jogalany-azonosító kódja CBCBCBCBCBCBCBCBCBCB) államkötvényt (ISIN kódja: NO0010732555) vesz X befektetési vállalkozástól.

Az alább bemutatott ügyletjelentés kizárólag X vállalkozás szempontjából készült.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</Exctg Pty> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	CB központi bank jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> </pre>
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <LEI>CBCBCBCBCBCBCBCBCBCB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> </pre>
41	Eszközazonosító kód	{Államkötvény ISIN kódja}	<pre> <AcctOwnr> <Id> </pre>

65	Értékpapír-finanszírozási ügyletek megjelölése	'true' (igaz)	<pre> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <FinInstrm> <Id>NO0010732555</Id> </FinInstrm> <AddtlAttrbts> ... <SctiesFincgTxInd>true</SctiesFinc gTxInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
----	--	---------------	---

IV. RÉSZ – Különböző eszköztípusok bejelentése

5.32 Alapelvek

Ahol a származtatott termék alapja egy másik származtatott termék, például egy részvényalapú határidős termékre képzett opció, az ügyletjelentésben az alaptermék kódját mutató mezőben (47. mező) a közvetlen alapterméket kell feltüntetni, tehát a példa esetében nem a végső alapterméket (a részvényt), hanem a határidős kontraktust. Ez érvényes a kereskedési helyszínen a kereskedésbe bevezetett vagy forgalmazott származtatott termékre is, mert arra csak az eszközazonosító kód (41. mező) vonatkozik.

Az árfolyam mezőben a 'NOAP' érték szerepeljen, ha az adott ügylet esetében az árfolyam nem értelmezhető (pl. ajándékozás). A „PNDG” érték akkor szerepeljen, ha az árfolyam még nem áll rendelkezésre, de várható. A '0' alapértelmezett értéként nem használható.

Jelentendő az a pénzügyi eszköz, amelynek az alapterméke index. Ide tartoznak azok az esetek is, ahol az index *"olyan pénzügyi eszközöket tartalmaz..., amelyekkel valamely kereskedési helyszínen kereskednek"*. E tekintetben érdemes megjegyezni, hogy a MiFIR 26. cikk (2) bekezdés d) pontja szerint az *"olyan pénzügyi eszközöket tartalmaz..., amelyekkel valamely kereskedési helyszínen kereskednek"* szövegrész indexre és kosárra egyaránt utal.

5.33 A kereskedési helyszínen kereskedett vagy az ESMA listában szereplő pénzügyi eszközök azonosítása

88. példa

Egy befektetési vállalkozás pénzügyi eszközt szerez, amelynek ISIN kódja BE9999999999.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
41	Eszközazonosító kód	Instrumentum {ISIN} száma	<Tx> <New>
42	Eszköz teljes neve		..
43	Eszközbesorolás		<FinInstrm>
44	Névleges pénznem 1		<Id>BE9999999999</Id>

45	Névleges pénznem 2		<code></FinInstrm></code> ... <code></New></code> <code></Tx></code>
46	Árszorzó		
47	Alaptermék kódja		
48	Alapul szolgáló index neve		
49	Alapul szolgáló index futamideje		
50	Opció típusa		
51	Kötési árfolyam		
52	Kötési árfolyam pénzneme		
53	Az opció gyakorlásának típusa		
54	Lejárat (maturity) időpontja		
55	Lejárat (expiry) időpontja		
56	Teljesítés típusa		

Ebben az esetben kizárólag az eszközzonosító kódot kell feltüntetni. Ha azonban az eszköz referenciaadataival kapcsolatos mezőkben is szerepelne adata, az illetékes hatóság emiatt ne utasítsa el az ügyletjelentést.

5.34 A kereskedési helyszínen nem kereskedett, illetve az ESMA listájában nem elérhető pénzügyi eszközök azonosítása

5.34.1 Az EU-n kívüli kereskedési platformon (nem EGK helyszínen) kereskedett pénzügyi eszközök

89. példa

Egy befektetési vállalkozás az alaptermék egy egységére vetítve 11,4653 dollár árfolyamon származtatott határidős kontraktusokkal (ISIN US0000000000) kereskedik egy EU-n kívüli szervezett kereskedési platformon (U kereskedési platform). Az alaptermék (ISIN GB0000000000) kereskedési helyszínen forog.

Az alapul szolgáló értékpapírból egyetlen származtatott ügyletbe tartozó egységek száma 1000 db.

A pénzügyi instrumentum besorolási kódja (CFI) FFSCSX, és az ügylet elszámolása készpénzben történik.

A nem EGK kereskedési helyszín szegmensazonosító (MIC) kódja XUSA, a határidős kontraktus lejáratának (expiry) időpontja 2018. június 19.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
36	Helyszín	U kereskedési platform szegmensazonosító {MIC} kódja	<code><New></code> ... <code><Tx></code> ... <code><TradVn>XUSA</TradVn></code>
41	Eszközzonosító kód	{Határidős ISIN}	... <code></Tx></code>

42	Eszköz teljes neve	'Határidős kontraktus'	<pre> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000000</Id> <FullNm>FUTURE CONTRACT</FullNm> <ClssfctnTp>FFSCSX</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-06-19</XpryDt> <PricMltplr>1000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </pre>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'1000'	
47	Alaptermék kódja	Az alapul szolgáló értékpapír {ISIN} kódja	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 06. 19.	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

Ha az EU-n kívüli szervezett kereskedési platformon kereskedett pénzügyi eszköznek van ISIN kódja, akkor azt a 41. mezőben tanácsos feltüntetni. Ha az ISIN kód nem szerepel az ESMA referenciaadatok listáján, akkor a 42-től 56-ig terjedő mezőket is ki kell tölteni.

5.34.2 OTC származtatott termékek

90. példa

Egy befektetési vállalkozás OTC kereskedik származtatott határidős kontraktusokkal. A származtatott határidős kontraktusoknak ugyan nincs ISIN kódja, de alapul szolgáló pénzügyi eszköz (ISIN GB0000000000) egy kereskedési helyszínen be van vezetve.

Az alapul szolgáló értékpapírból egyetlen származtatott ügylethez tartozó egységek száma 1000 db.

A határidős kontraktus pénzügyi instrumentum besorolási kódja FFSCSX, lejáratának (expiry) időpontja 2018. június 19. A kontraktus szállítása készpénzes.

Az árszorzó mezőben a közvetlen alapul szolgáló pénzügyi eszközre vonatkozóan is szerepel adat.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
36	Helyszín	'XXXX'	<New>
41	Eszközazonosító kód		...
42	Eszköz teljes neve	'FUTURE ONTRACT JUN 2018'	<Tx> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	...

46	Árszorzó	'1000'	<pre> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FUTURE CONTRACT JUN 2018</FullNm> <ClssfctnTp>FFSCSX</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-6-19</XpryDt> <PricMltplr>1000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
47	Alaptermék kódja	Alaptermék {ISIN} kódja	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 06. 19.	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

Az 5.34.1. és az 5.34.2. között az a különbség, hogy az eszközazonosító kódot (41. mező) az 5.34.2-ben bemutatott forgatókönyvnél nem kell feltüntetni.

5.35 Konkrét pénzügyi eszközök bejelentése

5.35.1 Részvény vagy részvényjellegű eszközök

91. példa

Egy befektetési vállalkozás 10 amerikai letéti igazolásra (ISIN: US0000000001) köt ügyletet az egyik amerikai piacon. Az alaptermék (ISIN: GB0000000001) kereskedési helyszínen forog. A pénzügyi eszköz besorolási (CFI) kódja EDSXFB.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'10'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10</Unit> </Qty> ... <TradVn>XUSA</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> </pre>
36	Helyszín	U kereskedési platform szegmenszo nosító {MIC} kódja	
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'1'	
47	Alaptermék kódja	Alaptermék {ISIN} kódja	

			<pre> <Id>US0000000001</Id> <ClssfctnTp>EDSRFB</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlyglInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlyglInstrm> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

5.35.2 Kötvények és az értékpapírosított hitel egyéb formái

5.35.2.1 Nettó áron teljesülő ügylet forgatókönyve³⁴

92. példa

Egy befektetési vállalkozás kötvényt vagy EDF 2,25% 2021 hitelviszonyt megtestesítő értékpapírosított pénzügyi eszközt (ISIN kódja FR0011637586) szerez OTC kereskedésben 98-on. Az ügylet névleges összege 1 000 000 EUR

Az ügylet nettó összege 982650,68 EUR.

A példa kedvéért feltételezzük az alábbiakat:

A (pénzügyi eszköz kibocsátásakor meghatározott) statikus jellemzők:

- Lejárat (maturity) időpontja: 2021. április 27.
- Névleges kamat: 2,25%
- Kamatfizetés gyakorisága: éves
- Kamatszámítási-szabály: ACT/ACT (azaz tényleges/tényleges)³⁵
- Elszámolási szabály: Ügylet napja után két munkanappal

Változók (azaz a piaci feltételektől függő dinamikus jellemzők):

- Kereskedési nap 2014. június 5.

³⁴ Nettó ár = bruttó ár – felhalmozott kamat

³⁵ Az ACT/ACT az ICMA által a kötvények esetében ajánlott szabály.

- Elszámolás napja: 2014. június 9. (az elszámolási szabály szerint)
- Utolsó kamatfizetés időpontja: 2014. április 27.
- Következő kamatfizetés időpontja: 2015. április 27.
- Eltelt napok száma: 43 (azaz az utolsó kamatfizetés időpontja és az elszámolás időpontja közötti napok száma)
- Periódus alapja: 365 (azaz az utolsó kamatfizetés időpontja és a következő kamatfizetés időpontja közötti napok száma)
- Mennyiség: 1 000 000 (azaz az ügylet névleges, avagy pénzben kifejezett értéke)
- Nettó ár: 98
- Felhalmozott kamat: 0,26506849 (azaz $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2.25}{1} \times \frac{43}{365}$)

Nominal coupon	Névleges kamat
Annual Coupon Frequency	Kamatfizetés éves gyakorisága
Accrued Number of Days	Eltelt napok száma
Period Basis	Periódus alapja

- Bruttó ár: 98,26506849 (azaz nettó ár + felhalmozott kamat = 98 + 0,26506849)

A nettó összeg kiszámítása (a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 35. mezőjében megadott képlet szerint) a következő:

$$\text{Nettó összeg} = (\text{nettó ár} \times \text{névleges érték}) + (\text{felhalmozott kamat} \times \text{névleges érték}) \text{ i.e. } \left(\frac{98}{100} \times \text{EUR } 1\,000\,000\right) + \left(\frac{0.26506849}{100} \times 1\,000\,000\right) = \text{EUR } 982650,68$$

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<New>
33	Árfolyam	'98'	...
35	Nettó összeg	'982650,68'	<Tx>
36	Helyszín	'XOFF'	...
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	<Qty>
			<NmnlVal
			Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
			</Qty>
			<Pric>
			<Pric>
			<Pctg>98</Pctg>
			</Pric>
			</Pric>
			<NetAmt>982650.68</NetAmt>
			<TradVn>XOFF</TradVn>
			</Tx>
			<FinInstrm>

			<pre> <Id>FR0011637586</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

5.35.2.2 Forgatókönyv, amelyben a pénzügyi eszköz ára egyszerűen diszkontált hozamként van kifejezve

93. példa

Egy befektetési vállalkozás a DTB 0% 12/30/16 holland kincstárjegyből (ISIN kódja NL0011923107) - 0,609%-on vásárol. Az ügylet névleges értéke 1 000 000 EUR

Az ügylet nettó összege 1002611,97 EUR.

A példa kedvéért feltételezzük az alábbiakat:

A (pénzügyi eszköz kibocsátásakor meghatározott) statikus jellemzők:

- Lejárat (maturity) időpontja: 2016. december 30.
- Kamatszámítási-szabály: ACT/360
- Elszámolási szabály: Ügylet napja után két munkanappal

Változók (azaz a piaci feltételektől függő dinamikus jellemzők):

- Kereskedési nap 2016. július 27.
- Elszámolás napja: 2016. július 29.
- Lejárat napokban: 154 (azaz az elszámolás időpontja és a lejárat (maturity) időpontja közötti napok száma)
- Periódus alapja: 360 (azaz az a napok száma összesen a szabály szerint)
- Mennyiség: 1 000 000 (azaz az ügylet névleges, avagy pénzben kifejezett értéke)
- A kincstárjegy diszkontált hozama: -0,609%
- Nettó ár: 100.261197 (azaz $\frac{100}{1 + \frac{Yield \cdot Days \text{ until maturity}}{100 \cdot Period \text{ Basis}}} = \frac{100}{1 + \frac{-0.609 \cdot 154}{100 \cdot 360}}$)

Yield	Hozam
Days until maturity	Lejárat napokban
Perior Basis	Periódus alapja

- Bruttó ár: 100,261197 (azaz nettó ár + felhalmozott kamat = 100,261197 + 0)

A nettó összeg kiszámítása (a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 35. mezőjében megadott képlet szerint) a következő:

Nettó összeg = (nettó ár x névleges érték) + (felhalmozott kamatok x névleges érték) azaz $(\frac{100.261197}{100} \times \text{EUR } 1\,000\,000) + (0 \times \text{EUR } 1\,000\,000) = \text{EUR } 1\,002\,611,97$

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<New>
			...
33	Árfolyam	'-0,609'	<Tx>
34	Az árfolyam pénzneme		...
35	Nettó összeg	1002611,97	<Qty>
36	Helyszín	'XOFF'	<NmnlVal
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
			</Qty>
			<Pric>
			<Pric>
			<Yld>-0.609</Yld>
			</Pric>
			</Pric>
			<NetAmt>1002611.97</NetAmt>
			<TradVn>XOFF</TradVn>
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Id>NL0011923107</Id>
			</FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>

5.35.2.3 Forгатókönyv, amelyben a pénzügyi eszköz ára (zérókupon) a kötvény hozamával van kifejezve

94. példa

Egy befektetési vállalkozás OTC forgalomban 1,06% százalékon vásárolja meg az FRTR 0% 04/25/2041 (ISIN kódja FR0010773200) leválasztott szelvényű értékpapírt. Az ügylet névleges értéke 1 000 000 EUR

Az ügylet nettó összege 770343,52 EUR.

A példa kedvéért feltételezzük az alábbiakat:

A (pénzügyi eszköz kibocsátásakor meghatározott) statikus jellemzők:

- Lejárat (maturity) időpontja: 2041. április 25.
- Kamatfizetés gyakorisága: nincs
- Kamatszámítási-szabály: ACT/ACT

- Elszámolási szabály: Ügylet napja után két munkanappal

Változók (azaz a piaci feltételektől függő dinamikus jellemzők):

- Kereskedési nap: 2016. július 25.
- Elszámolás napja: 2016. július 27.
- Periódus alapja: 365
- Lejárati napok (az elszámolás napjától, azaz 2016. július 27-től a lejárat (maturity) napjáig, azaz 2041. április 25-ig) "24+272/365 év"
- Mennyiség: 1 000 000 (azaz az ügylet névleges, avagy pénzben kifejezett értéke)
- A kincstárjegy kötvényhozama: 1,06%
- Nettó ár: 77.0343516 (azaz $\frac{100}{(1+\frac{Yield}{100})^{Time\ to\ maturity}} = \frac{100}{(1+\frac{1.06}{100})^{(24+\frac{272}{365})}}$)

Yield	Hozam
Time to maturity	Futamidő

- Bruttó ár: 77,0343516 (azaz nettó ár + felhalmozott kamat = 77,0343516 + 0)

A nettó összeg kiszámítása (a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 35. mezőjében megadott képlet szerint) a következő:

Nettó összeg = (nettó ár x névleges érték) + (felhalmozott kamatok x névleges érték) azaz $(\frac{77.0343516}{100} \times 1\ 000\ 000\ EUR) + (0 \times 1\ 000\ 000\ EUR) = 770343.52\ EUR$

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<New>
			...
33	Árfolyam	'1,06'	<Tx>
34	Az árfolyam pénzneme		...
35	Nettó összeg	770343,52	<Qty>
36	Helyszín	'XOFF'	<NmnlVal
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
			</Qty>
			<Pric>
			<Pric>
			<Yld>1.06</Yld>
			</Pric>
			</Pric>
			<NetAmt>770343.52</NetAmt>
			<TradVn>XOFF</TradVn>
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Id>FR0010773200</Id>

			</FinInstrm> ... </New> </Tx>
--	--	--	--

5.35.2.4 Átváltható kötvény

5.35.2.4.1 *Forgatókönyv, amelyben az átváltható kötvény ára a nettó ár:*

95. példa

Egy befektetési vállalkozás OTC forgalomban 114,00% százalékon vásárolja meg a Vodafone 2% 02/25/2019 (ISIN kódja XS1371473601) kötvényt. Az ügylet névleges értéke 1 000 000 GBP

Az ügylet nettó összege 1148406,59 GBP.

A példa kedvéért feltételezzük az alábbiakat:

A (pénzügyi eszköz kibocsátásakor meghatározott) statikus jellemzők:

- Lejárat (maturity) időpontja: 2019. február 25.
- Névleges kamat: 2%
- Kamatfizetés gyakorisága: Féléves
- Kamatszámítási-szabály: ICMA ACT/ACT
- Elszámolási szabály: Ügylet napja után két munkanappal

Változók (azaz a piaci feltételektől függő dinamikus jellemzők):

- Kereskedési nap: 2016. július 25.
- Elszámolás napja: 2016. július 27.
- Utolsó kamatfizetés időpontja: 2016. február 25.
- Következő kamatfizetés időpontja: 2017. augusztus 25.
- Eltelt napok száma: 153 (azaz az utolsó kamatfizetés időpontja és az elszámolás időpontja közötti napok száma)
- Periódus alapja: 182 (azaz az utolsó kamatfizetés időpontja és a következő kamatfizetés időpontja közötti napok száma)
- Mennyiség: 1 000 000 (azaz az ügylet névleges, avagy pénzben kifejezett értéke)
- Nettó ár: 114,00

- Felhalmozott kamat: 0,84065934 (azaz $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2}{2} \times \frac{153}{182}$)

Nominal Coupon	Névleges kamat
Annual Coupon Frequency	Kamatfizetés éves gyakorisága
Accrued Number of Days	Eltelt napok száma
Period Basis	Periódus alapja

- Bruttó ár: 114. 8406593 (azaz nettó ár + felhalmozott kamat = 114,00 + 0,84065934)

A nettó összeg kiszámítása (a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 35. mezőében megadott képlet szerint) a következő:

Nettó összeg = (nettó ár x névleges érték) + (felhalmozott kamatok x névleges érték) azaz $(\frac{114}{100} \times 1\,000\,000 \text{ GBP}) + (\frac{0,84065934}{100} \times 1\,000\,000 \text{ GBP}) = 1148406,59 \text{ GBP}$.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	<New>
33	Árfolyam	'114,00'	...
35	Nettó összeg	'1148406,59'	<Tx>
36	Helyszín	'XOFF'	...
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	<Qty> <NmnlVal Ccy="GBP">1000000</NmnlVal>
			</Qty>
			<Pric>
			<Pric>
			<Pctg>114.00</Pctg>
			</Pric>
			</Pric>
			<NetAmt>1148406.59</NetAmt>
			<TradVn>XOFF</TradVn>
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Id>XS1371473601</Id>
			</FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>

5.35.2.4.2 Forgatókönyv, amelyben a pénzügyi eszköz ára a kereskedés pénznemében van kifejezve

96. példa

Egy befektetési vállalkozás OTC forgalomban 10 000 CapGemini 0% 01/01/19 (ISIN kódja FR0011600352) átváltható kötvényt vesz 80 EUR árfolyamon. Az ügylet nettó összege 800 000 EUR = 10 000 x 80 EUR.

A példa kedvéért feltételezzük az alábbiakat:

A (pénzügyi eszköz kibocsátásakor meghatározott) statikus jellemzők az ügyletjelentés szempontjából nem relevánsak.

Változók (azaz a piaci feltételektől függő dinamikus jellemzők):

- Mennyiség: 10 000 (azaz a pénzügyi eszközök egységeinek darabszáma)
- A pénzügyi eszköz árfolyama a kereskedés pénznemében: 80 EUR

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'10000'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">80</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <NetAmt>800000</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>FR0011600352</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
31	A mennyiség pénzneme		
33	Árfolyam	'80'	
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
35	Nettó összeg	'800000'	
36	Helyszín	'XOFF'	
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	

5.35.3 Opció szerződések

5.35.3.1.1 Részvényopció

97. példa

Egy befektetési vállalkozás 10 vételi részvényopciós szerződést vesz egy másik befektetési vállalkozástól szerződésenként 11,46 EUR árfolyamon. Az vételi opcióval kereskedési helyszínen nem kereskednek, de az alapul szolgáló részvényt igen.

Az árszorzó (egy szerződés tárgyát képző alaprészvények száma) 5, a kötési ár (amelyen az opció lehívásakor az alaptermék adásvétele megtörténik) 70 EUR. A részvény ISIN kódja DE0000000001. A pénzügyi eszköz besorolási (CFI) kódja HESAVP.

Az opciós szerződés 2018. december 31-én jár le, és elszámolása fizikai szállítással történik.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
---	------	---------	--------------------

30	Mennyiség	'10'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">11.46</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>EQUITY CALL OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>HESAVP</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>5</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>DE0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">70</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>PHYS</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
33	Árfolyam	'11,46'	
34	Az ár pénzneme	'EUR'	
51	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'EQUITY CALL OPTION'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'5'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló részvény {ISIN} kódja	
50	Opció típusa	'CALL'	
51	Kötési árfolyam	'70'	
52	Kötési árfolyam pénzneme	'EUR'	
53	Az opció gyakorlásának típusa	'EURO'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 12. 31.	
56	Teljesítés típusa	'PHYS'	

OTC index alapú opciós szerződés

98. példa

Egy befektetési vállalkozás 50 db FTSE 100 indexre szóló egyedileg kialakított vételi opciós szerződést vásárol OTC forgalomban darabonként 2 GBP árfolyamon.

Az alaptermék a FTSE 100 Index (ISIN: GB0001383545).

A lejárat (expiry) időpontja 2018. augusztus 14. A kötési árfolyam 3500, az árszorzó pedig 25. Az opciós szerződés európai stílusú, elszámolása készpénzes.

Besorolási (CFI) kódja HEIAVC.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'50'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>50</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">2</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>HEIAVC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-08-14</XpryDt> <PricMltplr>25</PricMltplr> <UndrlyInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0001383545</ISIN> </Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Nm>FTSE100</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Othr> </UndrlyInstrm> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> </pre>
33	Árfolyam	'2'	
34	Az árfolyam pénzneme	GBP	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'25'	
47	Alaptermék kódja	Alaptermék {ISIN} kódja	
48	Alapul szolgáló index neve	{Az Index nevét ide kell beszúrni}	
50	Opció típusa	'CALL'	
51	Kötési árfolyam	'3500'	
53	Az opció gyakorlásának típusa	'EURO'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 08. 14.	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

			<pre> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <BsisPts>3500</BsisPts> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

5.35.4 Különbözeti ügylet

99. példa

Egy befektetési vállalkozás különbözeti ügyletet hajt végre. Az alapul szolgáló Vodafone részvény szabályozott piacon a kereskedésbe bevezetett eszköz, de a CFD nem forog kereskedési helyszínen.

A kereskedett különbözeti ügyletek darabszáma 10 000. A különbözeti ügylet árfolyama 3,374 EUR Az alapul szolgáló (Vodafone) részvény ISIN kódja GB00BH4HKS39.

A CFD besorolási (CFI) kódja JESXCC. Az árszorító 1, ami azt a tényt tükrözi, hogy egy CFD szerződés egy egységnyi alapterméket képvisel.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'10000'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">3.374</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> </FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>VODAFONE CFD</FullNm> <ClssfctnTp>JESXCC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> </pre>
33	Árfolyam	'3,374'	
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'VODAFONE CFD'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorító	'1'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló részvény {ISIN} kódja	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

			<pre> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB00BH4HKS39</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

5.35.5 Árfolyamkülönbözet spekuláció

5.35.5.1 Részvény-árfolyam-különbözet spekuláció

100. példa

Egy befektető adott részvény árfolyam-különbözetére naponta megújuló spekulatív pozíciót létesít. Az árfolyam-különbözet ügylettel kereskedési helyszínen nem kereskednek, de az alapul szolgáló részvennyel igen.

Az ügyletre feltett összeg 0,5 GBP, amely az aprópénzben kifejezett egységnyi árfolyamelmozdulásra vonatkozik.

Az alapul szolgáló pénzügyi eszköz (ABC PLC) referenciaára 102,23 EUR.

Az eszköz teljes neve szabadon kitölthető szöveges mező, amelyet a végrehajtó szervezet tölt ki: ABC BET SZEPT 15 ÁRFOLYAMKÜLÖNBÖZET. A részvény-árfolyam-különbözet ügylet besorolási (CFI) kódja JESXSC.

Az árszorító az alapul szolgáló pénzügyi eszköz árfolyamának pontokban mért elmozdulása: 100, azaz 1 eurónként 100 cent. Azaz az árfolyam minden centnyi elmozdulása 0,50 GBP-vel módosítja a befektető nyereségét vagy veszteségét.

Az alapul szolgáló részvény ISIN kódja GB0000000004.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'0,50'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">0.50</MntryVal> </pre>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	
33	Árfolyam	'102,23'	
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	'XXXX'	

41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'ABC BET SPREAD'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'100'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló részvény {ISIN} kódja	
55	Lejárat (expiry) időpontja		
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

```

</Qty>
<Pric>
  <Pric>
    <MntryVal>
      <Amt Ccy="EUR">102.23</Amt>
    </MntryVal>
  </Pric>
</Pric>
<TradVn>XXXX</TradVn>
...
</Tx>
<FinInstrm>
  <Othr>
    <FinInstrmGnlAttrbts>
      <FullNm>ABC BET SPREAD</FullNm>
      <ClssfctnTp>JESXSC</ClssfctnTp>
    </FinInstrmGnlAttrbts>
    <DerivInstrmAttrbts>
      <PricMltplr>100</PricMltplr>
      <UndrlygInstrm>
        <Othr>
          <Sngl>
            <ISIN>GB0000000004</ISIN>
          </Sngl>
        </Othr>
      </UndrlygInstrm>
      <DlvryTp>CASH</DlvryTp>
    </DerivInstrmAttrbts>
  </Othr>
</FinInstrm>
...
</New>
</Tx>

```

A naponta megújuló árfolyam-különbség spekuláció esetében csak a szerződés kezdeti nyitó illetve záró ügyletéről szükséges adatot szolgáltatni. A lejárat (expiry) időpontja üresen marad.

5.35.5.2 Határidős kötvényárfolyam spekuláció

101. példa

Az ügyletjelentésen belül az alaptermék kódja mezőben (47. mező) kitöltendő ISIN kód a közvetlen alapul szolgáló pénzügyi eszköz kódja. Ebben a példában ez a határidős kötvénykontraktus és nem a végső soron alapul szolgáló pénzügyi eszköz (azaz a kötvény) azonosítója lesz.

Egy befektető olyan határidős kötvénykontraktusra vonatkozó, naponta megújuló árfolyam-különbségi pozíciót vesz fel, amelyek esetében a határidős kötvénykontraktus kereskedési helyszínen forog.

A spekulációra feltett összeg az árfolyam egy pontnyi elmozdulása esetén 2 GBP. Az alapul szolgáló pénzügyi eszköz (bázispontokban kifejezett) referencia-árfolyama 9100 pont.

Az eszköz teljes neve szabadon kitölthető szöveges mező, amelyet a végrehajtó szervezet tölt ki: Bond Future BET 27MAY15.

Az árfolyam-különbözet ügylet besorolási (CFI) kódja JCAXSC.

Az árszorzó az alapul szolgáló pénzügyi eszköz árfolyamának pontokban mért elmozdulása: 1. Az alapul szolgáló határidős kötvénykontraktus ISIN kódja GB1234567891.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'2'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	<New>
33	Árfolyam	9100	...
36	Helyszín	'XXXX'	<Tx>
41	Eszközazonosító kód		...
42	Eszköz teljes neve	'BOND FUTURE BET 27MAY15'	<Qty>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal>
46	Árszorzó	'1'	</Qty>
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló határidős kontraktus {ISIN} kódja	<Pric>
55	Lejárat (expiry) időpontja		<Pric>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	<BsisPts>9100</BsisPts>
			</Pric>
			</Pric>
			<TradVn>XXXX</TradVn>
			...
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Othr>
			<FinInstrmGnlAttrbts>
			<FullNm>BOND FUTURE BET
			27MAY15</FullNm>
			<ClssfctnTp>JCAXSC</ClssfctnTp>
			</FinInstrmGnlAttrbts>
			<DerivInstrmAttrbts>
			<PricMltplr>1</PricMltplr>
			<UndrlygInstrm>
			<Othr>
			<Sngl>
			<ISIN>GB1234567891</ISIN>
			</Sngl>
			</Othr>
			</UndrlygInstrm>
			<DlvryTp>CASH</DlvryTp>
			</DerivInstrmAttrbts>
			</Othr>
			</FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>

5.35.5.3 Index alapú árfolyam-különbözet spekuláció

102. példa

Egy befektető egy olyan részvényindex árfolyamára köt spekulatív különbözeti ügyletet, amelynek legalább egy pénzügyi eszközzel kereskedési helyszínen kereskednek. Az árfolyam-különbözet ügylettel kereskedési helyszínen nem kereskednek.

A spekulációra feltett összeg az árfolyam egy pontnyi elmozdulása esetén 10 GBP, míg az alapul szolgáló pénzügyi eszköz referencia-árfolyama 9340.

Az eszköz teljes neve szabadon kitölthető szöveges mező, amelyet a végrehajtó szervezet tölt ki: FTSE Index BET.

Az index alapú árfolyam-különbözet ügylet besorolási (CFI) kódja JEIXSC.

Az árfolyam-különbözeti pozíció T+1 időpontban jár le, ahol T 2018. 10. 27.

Az árszorító az alapul szolgáló index árfolyamának pontokban mért elmozdulása, azaz 1. Az index árfolyamának egy pontnyi elmozdulása a befektető nyereségét illetve veszteségét 10 GBP-vel módosítja

Az index ISIN kódja GB0001383545.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'10'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	<New>
33	Árfolyam	'9340'	...
36	Helyszín	'XXXX'	<Tx>
41	Eszközazonosító kód		...
42	Eszköz teljes neve	'FTSE INDEX BET'	<Qty>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<MntryVal Ccy="GBP">10</MntryVal>
46	Árszorító	'1'	</Qty>
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló index {ISIN} kódja	<Pric>
48	Alapul szolgáló index neve	'FTSE100'	<Pric>
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 10. 28.	<BsisPts>9340</BsisPts>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	</Pric>
			<TradVn>XXXX</TradVn>
			...
			</Tx>
			<FinInstrm>
			<Othr>
			<FinInstrmGnlAttrbts>
			<FullNm>FTSE INDEX BET</FullNm>
			<ClssfctnTp>JEIXSC</ClssfctnTp>
			</FinInstrmGnlAttrbts>
			<DerivInstrmAttrbts>
			<XpryDt>2018-10-28</XpryDt>
			<PricMltplr>1</PricMltplr>
			<UndrlygInstrm>
			<Othr>
			<Sngl>
			<Indx>
			<ISIN>GB0001383545</ISIN>
			<Nm>
			<RefRate>
			<Nm>FTSE100</Nm>
			</RefRate>
			</Nm>
			</Indx>
			</Sngl>
			</Othr>

			<pre> </UndrlyInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

5.35.5.4 Árfolyamkülönbözet spekuláció szervezett kereskedési rendszerben kereskedett deviza határidős árfolyam-megállapodásra (FRA)

103. példa

Egy befektető árfolyam-különbözeti spekulatív pozíciót vesz fel egy 1 éves határidős árfolyam-megállapodásra (GBP/USD FRA JUN16). Az árfolyam-különbözet ügylettel kereskedési helyszínen nem kereskednek.

A GBP/USD FRA JUN16 1,5355-ön (árfolyam) forog.

A feltett összeg 5 GBP, amely az aprópénzben kifejezett egységnyi árfolyamelmozdulásra vonatkozik. Az árszorító az alapul szolgáló pénzügyi eszköz aprópénzben kifejezett referencia-árfolyamának pontokban mért elmozdulása: 100.

A GBP/USD FRA JUN16 ISIN kódja GB0000000006.

A GBP/USD FRA árfolyam-különbözeti spekuláció besorolási (CFI) kódja JFRXSC.

Az FRA lejárat (expiry) időpontja 2016. június 30-a, és ekkor jár le az árfolyam-különbözeti spekuláció is.

Az árfolyam-különbözeti spekuláció teljesítése készpénzes.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'5'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	<New>
			...
33	Árfolyam	'1,5355'	<Tx>
			...
34	Az árfolyam pénzneme	GBP	<Qty>
36	Helyszín	'XXXX'	<MntryVal Ccy="GBP">5</MntryVal>
			</Qty>
41	Eszközazonosító kód		<Pric>
			<Pric>
42	Eszköz teljes neve	'GBP/USD FRA JUN16 BET'	<MntryVal>
			<Amt Ccy="GBP">1.5355</Amt>
			</MntryVal>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	</Pric>
46	Árszorító	'100'	</Pric>
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló	<TradVn>XXXX</TradVn>
			...

		FRA {ISIN} kódja	</Tx>
55	Lejárat (expiry) időpontja	2016. 06. 30.	<FinInstrm>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	<Othr>
			<FinInstrmGnlAttrbts>
			<FullNm>GBP/USD FRA JUN16
			BET</FullNm>
			<ClssfctnTp>JFRXSC</ClssfctnTp>
			</FinInstrmGnlAttrbts>
			<DerivInstrmAttrbts>
			<XpryDt>2016-06-30</XpryDt>
			<PricMltplr>100</PricMltplr>
			<UndrlygInstrm>
			<Othr>
			<Sngl>
			<ISIN>GB0000000006</ISIN>
			</Sngl>
			</Othr>
			</UndrlygInstrm>
			<DlvryTp>CASH</DlvryTp>
			</DerivInstrmAttrbts>
			</Othr>
			</FinInstrm>
			...
			</New>
			</Tx>

5.35.5.5 Árfolyamkülönbözet spekuláció szervezett kereskedési rendszerben kereskedett kamatopcióra

104. példa

Egy befektető bázispontonként 2 GBP értéken árfolyam-különbözeti spekulatív pozíciót nyit egy hathavi GBP LIBOR opcióra

A hathavi GBP LIBOR opció T helyszínen 0,71375 százalékon forog. A hathavi GBP LIBOR opció ISIN kódja GB0000000007.

A GBP LIBOR opciós árfolyam-különbözet spekuláció besorolási (CFI) kódja JFMXSC.

A hathavi GBP LIBOR opció lejárat (expiry) időpontja 2018. december 17-e, hétfő, és ekkor jár le az árfolyam-különbözeti spekuláció is.

Az árszorító 10 000, mert 1 bázispont 0,01%-nak felel meg. A referenciaárfolyam minden egyes 0,01 százalékos elmozdulása 2 GBP-vel módosítja a befektető nyereségét illetve veszteségét.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'2'	<Tx>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	<New>
			...
33	Árfolyam	'0,71375'	<Tx>
			...
36	Helyszín	'XXXX'	<Qty>

41	Eszközazonosító kód		<pre> <MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0.71375</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>OPTION GBP LIBOR DEC15 BET</FullNm> <ClssfctnTp>JRMXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-17</XpryDt> <PricMltplr>10000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000007</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
42	Eszköz teljes neve		
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'10000'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáltató opció {ISIN} kódja	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 12. 17.	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

Az ügyletjelentésben azonosított alaptermék a kamatopciós szerződés.

5.35.6 Hitel-nemteljesítési csereügylet

105. példa

X befektetési vállalkozás OTC forgalomban hitel-nemteljesítési csereügylet (CDS) szerződést vesz egymillió (azaz 1 000 000) euróért 100 bázispontos kamattal Y befektetési vállalkozástól. A CDS elszámolása készpénzben történik.

Lejárata 2020. július 30.

X befektetési vállalkozásnak Y befektetési vállalkozás 33 879 EUR összeget fizet előlegként.

A kereskedési helyszínen forgó kötvény alaptermék ISIN kódja ZA2344558978. A CDS besorolási (CFI) kódja SCUCCC.

Az alábbi ügyletjelentés kizárólag X vállalkozás szempontjából készült.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
30	Mennyiség	'1000000'	<Sellr>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<AcctOwnr> <Id>
33	Árfolyam	'100'	
36	Helyszín	'XXXX'	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
38	Előleg	'-33879'	</AcctOwnr>
39	Az előleg pénzneme	'EUR'	</Sellr>
41	Eszközazonosító kód		<Tx>
42	Eszköz teljes neve	'ALLIANZ SE SNR CDS'	<Qty> <NmnlVal
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
46	Árszorzó	'1'	</Qty>
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló kötvény {ISIN} kódja	<Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric>
55	Lejárat (expiry) időpontja	2021. 06. 20.	</Pric> <TradVn>XXXX</TradVn>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	<UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">33879</Amt> <Sgn>>false</Sgn> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ALLIANZ SE SNR CDS</FullNm> <ClssfctnTp>SCUCCC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2021-06-20</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>ZA2344558978</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ..

			</New> </Tx>
--	--	--	-----------------

Ha nincs előre fizetett összeg, a 38. mezőben '0' szerepeljen.

Ha az előleg összegét X befektetési vállalkozás kapja, és nem fizeti, akkor a 38. mezőben feltüntetett előleg negatív lesz.

5.35.7 Csereügyletek

Ahol az ügylet több pénzmozgást is tartalmaz, és a mozgások irányát nem lehet a vevő/eladó mezőben megadott hivatkozással jelezni, akkor ezt értelemszerűen az alaptermék kódja vagy az alapul szolgáló index neve előtt álló "+" vagy "-" jel mutatja meg. A "+" azt jelzi, hogy az alapterméket (annak teljesítményét) a vevő kapja, míg a "-" jel azt mutatja, hogy az alapterméket (annak teljesítményét) a vevő fizeti. A példákban bemutatott táblázatokban a csereügylet irányának érzékeltetése érdekében ugyan szerepelnek ezek a "+" és "-" jelek, amelyek azonban az XML sémában XML záró címkeként jelennek meg a releváns jelentendő érték mellett (pl. alaptermék kódja). Az XML szövegben a "+" és a "-" jel helyett a 'SwapIn' vagy a 'SwapOut' szöveg áll.

Elvárás, hogy a befektetési vállalkozások a "+" és a "-" jelet pontosan és következetesen használják. Ha a csereügylet szerződés vevője vagy eladója nem következtethető ki az 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet vonatkozó mezőinek megnevezéséből, pl. két részvénylábát tartalmazó részvénycsere ügyletnél a 47. és/vagy a 48. mezőben álló "+" és a "-" jel pontosan tükrözze, hogy mit kap az ügyletjelentésben vevőként azonosított, és mit fizet az abban eladóként megjelölt vállalkozás.

Előlegfizetés bármely csereügylet szerződésre vonatkozhat.

5.35.7.1 Részvénycsere ügylet (egy részvényláb)

106. példa

X befektetési vállalkozás OTC forgalomban részvénycsere ügyletet köt Y befektetési vállalkozással. Az alapul szolgáló részvennyel kereskedési helyszínen kereskednek. X vállalkozás átveszi az alapul szolgáló részvény árfolyammozgásával járó kockázatot, és 0,05% felárral növelt három havi LIBOR-t fizet.

A csereügylet szerződés névleges értéke 1 000 000 EUR, az alapul szolgáló részvény referenciaárfolyama 50 USD. A csereügylet szerződés 2018. december 31-én jár le, és elszámolása készpénzben történik.

Az eszköz teljes neve BAYER EQS LIBOR3M+ 0.05%. A részvénycsere ügylet besorolási (CFI) kódja SESPXC.

Az alapul szolgáló részvény a Bayer AG NA (ISIN DE000BAY0017)

Az alapul szolgáló kamat három hónapos futamidő mellett a háromhavi LIBOR 3,7%-on + 0,05% felár.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	</AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id>
30	Mennyiség	'1000000'	
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id>
33	Árfolyam	'0,05'	</AcctOwnc>
34	Az ár pénzneme		</Sellr>
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		... <Tx>
42	Eszköz teljes neve	'BAYER EQS LIBOR3M+0.05% SEP 15'	... <Qty> <NmnlVal
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
44	Névlleges pénznem 1	'EUR'	</Qty>
46	Árszorzó	'1'	<Pric>
47	Alaptermék kódja	'+'DE000BAY0017'	<Pric> <Pctg>0.05</Pctg>
48	Alapul szolgáló index neve	'-'LIBO'	</Pric>
49	Alapul szolgáló index futamideje	'3'MNTH'	<TradVn>XXXX</TradVn> </Tx>
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 12. 31.	<FinInstrm> <Othr>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	<FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>BAYER EQS LIBOR3M+0.05% SEP 15</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <ISIN>DE000BAY0017</ISIN> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <Indx>

			<pre> <Nm> <RefRate> <Indx>LIBO</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>MNTH</Unit> <Val>3</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlyInstrm> <DivryTp>CASH</DivryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Figyelmet érdemel, hogy a 30. mezőben (Mennyiség) a bejelentett csereügylet szerződés névleges értékét kell feltüntetni. A 46. mezőben (Árszorító) az ügyletbe foglalt csereszerződések számát kell szerepeltetni. A 33. mezőben (Árfolyam) az alapul szolgáló kamaton felül megfizetett/kapott felár szerepeljen.

Az alaptermék kódja előtt álló "+" jel azt mutatja, hogy a BAYER AG NA teljesítményét a vevő kapja.

Az alapul szolgáló index neve előtt álló "-" jel arra utal, hogy a vevő fizeti a kamatot.

5.35.7.2 EU-n kívüli kereskedési platformon forgó (két részvénylábát tartalmazó) részvénycsere ügylet (az eszköz nem szerepel az ESMA listáján)

107. példa

X befektetési vállalkozás részvénycsere kontraktust vesz egy EU-n kívüli kereskedési platformon, amely ezért nem szerepel az ESMA listáján. Az alapul szolgáló részvényindexek szabályozott piacon bevezetett pénzügyi eszközöket tartalmaznak.

A kereskedési platform központi szerződő féllel áll kapcsolatban, amelynek jogalany-azonosító kódja CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

A csereszerződés ISIN kódja US000DAX000X, és a szerződésben rögzített névleges összeg 1 000 000 EUR.

A szerződés 2016. június 25-én jár le, és elszámolása készpénzben történik.

Az egyik alaptermék a DAX 30 Index (ISIN: DE0008469008)

A másik alaptermék az IBEX 35 Index (ISIN: ES0SI0000005).

A csereszerződés felára '0', és a két befektetési vállalkozás megállapodása szerint X vállalkozás 1000 EUR előleget fizet Y vállalkozásnak.

A részvéncsere ügylet helyszínének kódja XUSA, és ez a helyszín központi szerződő féllel áll kapcsolatban, amelynek a jogalany-azonosító kódja CCPCCPCCPCCPCCPCC.

Az eszköz teljes neve szabadon kitölthető szöveges mező, amelyet a végrehajtó szervezet tölt ki: DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16

A részvéncsere ügylet besorolási (CFI) kódja SEIPXC.

A DAX teljesítményét X befektetési vállalkozás kapja majd, az IBEX teljesítményét viszont ő fizeti.

X és Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés	
		X befektetési vállalkozás	Y befektetési vállalkozás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	A központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	A központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
30	Mennyiség	1000000	1000000
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	'EUR'
33	Árfolyam	'0'	'0'
34	Az ár pénzneme		
36	Helyszín	'XUSA'	'XUSA'
38	Előleg	'1000'	'1000'
39	Az előleg pénzneme	'EUR'	'EUR'
41	Eszközazonosító kód	{ISIN}	{ISIN}
42	Eszköz teljes neve	'DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16'	'DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16'
43	Eszközbesorolás	'SESPXC'	'SESPXC'
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	'EUR'
46	Árszorító	'1'	1:
47	Alaptermék kódja	'+'{DAX 30 ISIN kódja} '-'{IBEX 35 ISIN kódja}	'+'{DAX 30 ISIN kódja} '-'{IBEX 35 ISIN kódja}
48	Alapul szolgáló index neve	'+'DAX 30' '-'IBEX 35'	'+'DAX 30' '-'IBEX 35'
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2016-06-25'	'2016-06-25'
56	Teljesítés típusa	'CASH'	'CASH'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XUSA</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">1000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US000DAX000X</Id> <FullNm>DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnc> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnc> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XUSA</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">1000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US000DAX000X</Id> <FullNm>DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> </pre>

<pre> <Indx> <ISIN>DE0008469008</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>DAX 30</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <ISIN>ES0SI0000005</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlyInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <Indx> <ISIN>DE0008469008</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>DAX 30</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <ISIN>ES0SI0000005</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </UndrlyInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
---	---

A másik megoldás szerint Y befektetési vállalkozás is benyújthat jelentést, amelyben vevőként X vállalkozás helyett saját magát tünteti fel. Ebben az esetben az alaptermékre vonatkozó mezőkben az előjeleket megfelelően módosítani kell, hogy pontosan jelezzék, hogy az alaptermékek közül (melyiknek a teljesítményét) kapja illetve fizeti a vevő.

5.35.7.3 OTC (két részvénylábat tartalmazó) részvénycsere ügylet (az eszköz nem szerepel az ESMA listáján)

108. példa

X befektetési vállalkozás OTC részvénycsere ügyletet köt Y befektetési vállalkozással. Az alapul szolgáló részvényekkel kereskedési helyszínen kereskednek. A szerződés 2016. június 25-én jár le, és elszámolása készpénzben történik. A részvénycsere szerződésben rögzített névleges érték 1 000 000 EUR. Felár fizetésére nem kerül sor.

Az egyik alaptermék az Orange (ISIN FR0000133308).

A másik alaptermék a Telefonica (ISIN ES0178430E18).

Az eszköz teljes neve szabadon kitölthető szöveges mező, amelyet a végrehajtó szervezet tölt ki: ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16. A részvénycsere ügylet besorolási (CFI) kódja SESPXC.

A Orange részvény teljesítményét X befektetési vállalkozás kapja majd, az Telefonica részvény teljesítményét viszont ő fizeti.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	X vállalkozás értékközlése	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> ... <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
30	Mennyiség	'1000000'	
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
33	Árfolyam	'0'	</AcctOwnr>
34	Az ár pénzneme		</Sellr>
36	Helyszín	'XXXX'	...
41	Eszközazonosító kód		<Tx> ...
42	Eszköz teljes neve	'ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16'	<Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<Pric>
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	<Pric>
46	Árszorzó	'1'	<Pctg>0</Pctg> </Pric>
47	Alaptermék kódja	'+'{alapul szolgáltató Orange részvény ISIN kódja} '-'{alapul szolgáltató Telefonica részvény ISIN kódja}	</Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16</FullNm>
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2016-06-25'	<ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	</FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt>

			<pre> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	---

Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	X vállalkozás Y vállalkozás	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> ... <New> ... </pre>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">100000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> </pre>
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	

			<pre> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
30	Mennyiség	'1000000'	
33	Árfolyam		
34	Az ár pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	
47	Alaptermék kódja	'-{alapul szolgált Orange részvény ISIN kódja}'+{alapul szolgált Telefonica	

		részvény ISIN kódja}	
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2016-06-25'	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

Egy másik megoldás szerint Y befektetési vállalkozás is benyújthat jelentést, amelyben vevőként X vállalkozás helyett saját magát tünteti fel. Ebben az esetben az alaptermékre vonatkozó mezőkben az előjeleket megfelelően módosítani kell, hogy pontosan jelezzék, hogy az alaptermékek közül (melyiknek a teljesítményét) kapja illetve fizeti a vevő.

5.35.7.4 OTC teljes hozam-csereügylet (az eszköz nem szerepel az ESMA listáján)

109. példa

X befektetési vállalkozás az Austrian Traded Index (ATX) alaptermékre OTC teljes hozam-csereügyletet köt. Az ATX ISIN kódja AT0000999982. X befektetési vállalkozás a kamatot fizeti, melynek megállapított mértéke háromhavi EURIBOR + 30 bázispont, Y befektetési vállalkozás pedig az index teljes hozamát, beleértve a megtermelt jövedelmet és az esetleges tőkenövekményt. Y befektetési vállalkozás eladja a teljes hozam-csereügyletet, míg X befektetési vállalkozás a csereszerződés vevője, hiszen az alaptermék megtérülése őt anélkül illeti meg, hogy az meghatározott összeg fizetése ellenében fizikailag a tulajdonába kerülne.

A 2018. december 15-én lejáráó szerződésben rögzített névleges érték 2 000 000 EUR.

A megállapodás szerint X vállalkozás 15 000 EUR előleget fizet Y vállalkozásnak. A besorolási CFI kód SEITXC, és a szerződés elszámolása készpénzes.

N	Mező	Értékközlés	
		X befektetési vállalkozás	Y befektetési vállalkozás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
30	Mennyiség	'2000000'	'2000000'
33	Árfolyam	'30'	'30'
34	Az árfolyam pénzneme		
36	Helyszín	'XXXX'	'XXXX'
38	Előleg	'15000'	'15000'
39	Az előleg pénzneme	'EUR'	'EUR'
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS'	'TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS'
43	Eszközbesorolás	SEITXC	SEITXC
44	Névleges pénznem	'EUR'	'EUR'

46	Árszorzó	'1'	'1'
47	Alaptermék kódja	'+'{Alapul szolgáló ATX index ISIN kódja}	'+'{Alapul szolgáló ATX index ISIN kódja}
48	Alapul szolgáló index neve	'-'{EURI index neve}	'-'{EURI index neve}
49	Alapul szolgáló index futamideje	'3MNTH'	'3MNTH'
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2018-12-15'	'2018-12-15'
56	Teljesítés típusa	'CASH'	'CASH'

XML-beli ábrázolás:

X befektetési vállalkozás jelentése	Y befektetési vállalkozás jelentése
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>30</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">15000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS</FullNm> </FinInstrmGnlAttrbts> </Othr> </FinInstrm> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNQRST</Exc tgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>30</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">15000</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> </pre>

<pre> <ClssfctnTp>SCITSC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> <Indx> <ISIN>AT0000999982</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>ATX</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>EURI</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>Mnth</Unit> <Val>3</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <FullNm>TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS</FullNm> <ClssfctnTp>SCITSC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Sngl> <Indx> <ISIN>AT0000999982</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>ATX</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>EURI</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>Mnth</Unit> <Val>3</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
---	--

5.35.7.5 OTC részvénykosár-csereügylet (az eszköz nem szerepel az ESMA listáján)

110. példa

X befektetési vállalkozás (a "részvényösszeg fizetésére kötelezett") kétéves, készpénzes elszámolású, OTC részvénykosár-csereügyletet köt 2018. június 15-én Y befektetési vállalkozással (a "rögzített kamat fizetésére kötelezett") 1 éves LIBOR 3,7%-os kamat + 5 bázisponton. X befektetési vállalkozás vállalja, hogy lejáratkor a négy részvényből álló részvénykosár teljes teljesítményét (a kosár kezdő

értéke: 21,85 EUR) megfizeti Y befektetési vállalkozásnak. A csereügylet tárgyát képező részvények száma 1 000 000, ebből adódik, hogy a részvénycsere névleges értéke 21 850 000 EUR.

A kosár négy részvényből áll, ezek közül három EGK kereskedési helyszínen a kereskedésbe bevezetve:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)
- Cargotec (ISIN FI0009013429)
- Intel Corporation (ISIN US4581401001)

A MiFIR 26. cikk (2) bekezdésének c) pontja alapján a 47. mezőben (Alaptermék kódja) nem kell feltüntetni a kosárban található USA részvényt, mert azzal EGK kereskedési helyszínen nem kereskednek.

A szerződés 2018. június 15-én jár le, besorolási (CFI) kódja SEBPXC. A szerződés készpénzes elszámolású.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
30	Mennyiség	'21850000'	<Sellr>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<AcctOwnr> <Id>
33	Árfolyam	'5'	<LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>
34	Az árfolyam pénzneme		</AcctOwnr>
36	Helyszín	'XXXX'	</Sellr>
41	Eszközazonosító kód		... <Tx>
42	Eszköz teljes neve	'KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018'	... <Qty>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<NmnlVal
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	Ccy="EUR">218550000</NmnlVal>
46	Árszorító	'1'	</Qty>

47	Alaptermék kódja	'+' FI0009005870' '+' FI0009014575' '+' FI0009013429'	<pre> <Pric> <Pric> <BsisPts>5</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018</FullNm> <ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-06-15</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <Swpln> <Bskt> <ISIN>FI0009005870</ISIN> <ISIN>FI0009014575</ISIN> <ISIN>FI0009013429</ISIN> </Bskt> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Indx>LIBO</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>YEAR</Unit> <Val>1</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
48	Alapul szolgáló index neve	'-'LIBO'	
49	Alapul szolgáló index futamideje	'1YEAR'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2018-06-15'	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

Ebben az esetben Y befektetési vállalkozás a részvénykosár-csereügylet vevője, hiszen ő kapja a részvénykosár teljesítményét.

5.35.7.6 Két kosárra OTC csereügylet (az eszköz nem szerepel az ESMA listáján)

111. példa

X befektetési vállalkozás ("A. kosár teljesítményének fizetésére kötelezett") kétéves, készpénzes elszámolású, OTC részvénykosár-csereügyletet köt 2018. július 15-én Y befektetési vállalkozással ("B. kosár teljesítményének fizetésére kötelezett"). X befektetési vállalkozás vállalja, hogy lejáratkor kifizeti A. részvénykosár teljes teljesítményét, Y befektetési vállalkozás pedig azt vállalja, hogy B. részvénykosár teljes teljesítményét fizeti ki lejáratkor. A részvénycsere ügylet névleges értéke 10 000 000 EUR

A. részvénykosár két (kereskedési helyszínen kereskedett) részvényből áll, a kosár referenciaárfolyama pedig 16,10 EUR.

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)

B. részvénykosár szintén két (kereskedési helyszínen kereskedett) részvényből áll, a kosár referenciaárfolyama pedig 40.85 SEK.

- Elisa (ISIN FI0009007884)
- TeliaSonera (ISIN SE0000667925)

A szerződés 2018. július 15-én jár le, besorolási (CFI) kódja SEBPXC.

A csereügylet felára '0'.

Az alább bemutatott ügyletjelentések kizárólag X vállalkozás szempontjából készültek.

N	Mező	X vállalkozás értékközlése	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	y> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
30	Mennyiség	'10000000'	<Sellr>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<AcctOwnr> <Id>
33	Árfolyam	'0'	<LEI>12345678901234567890</LEI>
34	Az árfolyam pénzneme		</Id>

36	Helyszín	'XXXX'	</AcctOwnr>
41	Eszközazonosító kód		</Sellr>
42	Eszköz teljes neve	'RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018'	... <Tx> ... <Qty>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<NmnlVal
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	Ccy="EUR">10000000</NmnlVal>
46	Árszorzó	'1'	</Qty>
47	Alaptermék kódja	"+"FI0009007884 "+" SE0000667925 "-" FI0009005870 "-" FI0009014575'	<Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx>
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2018-07-15'	<FinInstrm>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	<Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018</FullNm> <ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-07-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Bskt> <ISIN>FI0009007884</ISIN> <ISIN>SE0000667925</ISIN> </Bskt> </SwpIn> <SwpOut> <Bskt> <ISIN>FI0009005870</ISIN> <ISIN>FI0009014575</ISIN> </Bskt> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Ha Y befektetési vállalkozás benyújtott jelentést, amelyben vevőként X vállalkozás helyett saját magát tünteti fel, az alaptermékre vonatkozó mezőkben az előjeleket megfelelően módosítani kell, hogy pontosan jelezzék, hogy az alaptermékek közül (melyiknek a teljesítményét) kapja illetve fizeti a vevő.

5.35.7.7 Kereskedési helyszínen kötött hagyományos kamatcsere ügylet (az eszköz nem szerepel az ESMA listáján)

112. példa

X befektetési vállalkozás Y befektetési vállalkozástól 100 000 000 GBP névleges összegű hagyományos kamatcsere ügyletet (ISIN XS0000000003) vesz M kereskedési helyszínen. A csereügylet lejáratának időpontja 2025. október 21. Az egyszerűség kedvéért feltételezzük, hogy a csereügylet felára nulla.

X befektetési vállalkozás félévente 1,8655% kamatot fizet (Act/365F), míg Y vállalkozás félévente (Act/365F) a hathavi GBP-LIBOR kamatot fizeti.

A csereügylet felára '0'.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	X befektetési vállalkozás értékközlése	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
30	Mennyiség	'100000000'	<LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	<Sellr> <AcctOwnr> <Id>
33	Árfolyam	'0'	
34	Az árfolyam pénzneme		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	</AcctOwnr> </Sellr> ...
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	<Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="GBP">100000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn>

			<pre> </Tx> <FinInstrm> <Id>XS0000000003</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--	--	--

A 33. mezőben feltüntetett árak összhangban kell lennie az instrumentum referenciaadataiban szereplő fix árfolyam értékével.

5.35.8 Árualapú származtatott termékek

5.35.8.1 OTC opció kereskedési helyszínen kereskedett árualapú határidős termékre

113. példa

X befektetési vállalkozás 100 db Amerikai, limitár felett érvényes, limitáras határidős kukorica termékre szóló vételi opciót vesz. A kötési árfolyam 168 EUR, az lejárat időpontja 2018. augusztus 30. Egy opciós szerződés alapján a vevő egy határidős kukorica kontraktusra jogosult.

Az opcióért fizetett díj 0,95 EUR.

A limitáras opciós szerződés alapterméke az Euronext Paris piacon 170 EUR árfolyamon kereskedett határidős kontraktus. A határidős kukorica kontraktus kötésegysége 50 tonna, a szerződés ISIN kódja FR0000000000.

A limitárat 172 EUR-ban határozzák meg (tehát az opciós szerződés csak akkor lép érvénybe, ha az alapul szolgáló határidős kontraktus árfolyama eléri a limitet).

Az limitáras opció besorolási (CFI) kódja HTFBBC, és az ügylet elszámolása készpénzben történik.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	X vállalkozás értékközlése	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> </pre>
30	Mennyiség	'100'	
33	Árfolyam	'0,95'	
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		<pre> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">0.95</Amt> </pre>
42	Eszköz teljes neve	'UPANDIN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORNFUTURES CONTRACT'	

43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<pre> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>UP AND IN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORN FUTURES CONTRACT</FullNm> <ClssfctnTp>OCAFCN</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-08-30</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlyInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>FR0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlyInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">168</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>AMER</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
46	Árszorzó	'1'	
47	Alaptermék kódja	{Határidős kukorica kontraktus ISIN kódja}	
50	Opció típusa	'CALL'	
51	Kötési árfolyam	'168'	
52	Kötési árfolyam pénzneme	'EUR'	
53	Az opció gyakorlásának típusa	'AMER'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2018. 08. 30.'	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

A limitáras opció alapterméke a határidős kukorica kontraktus, ezért a 47. mezőben az Euronext határidős kukorica kontraktus azonosítója áll.

Az ügyletjelentésben az eszköz referenciaadatait tartalmazó mezők írják le a limitáras opciót.

5.35.8.2 Kibocsátási egység ügylet

114. példa

X befektetési vállalkozás 3000 európai kibocsátási egységet vesz darabonként 7,50 EUR áron az Európai Energiatőzsde (MIC XEEE) szabályozott piacán.

Az eszköz ISIN kódja DE000A1DKQ99.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
30	Mennyiség	'3000'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
33	Árfolyam	'7,50'	
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	
41	Eszközazonosító kód	{Kibocsátási egység ügylet ISIN kódja}	... <Tx> ... <Qty> <Unit>3000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.50</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A1DKQ99</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.8.3 Határidős kibocsátási egység kontraktus

115. példa

X befektetési vállalkozás 5 európai kibocsátási egységet vesz darabonként 7,90 EUR áron az Európai Energiatőzsde (MIC XEEE) szabályozott piacán (1 határidő kontraktus 1000 európai CO2 kibocsátási egységet képvisel).

A határidős kibocsátási egység kontraktus ISIN kódja DE000A0SYVA6.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
30	Mennyiség	'5'	
33	Árfolyam	'7,90'	

34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
41	Eszközazonosító kód	{A határidős kontraktus ISIN kódja}	<Tx> ...
			<Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.90</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A0SYVA6</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.8.4 OTC opció kibocsátási egységre szóló, kereskedési helyszínen kereskedett határidős termékre

116. példa

X befektetési vállalkozás 5 db európai stílusú, kibocsátási egységre szóló, kereskedési helyszínen kereskedett határidős termékre vonatkozó vételi opciót vesz. A megfizetett opciós díj 1,00 EUR, és az opciós szerződés 2018. december 31-én jár le. Ez az opció kereskedési helyszínen nem forog, és ISIN kódja sincs.

Az árszorzó (azaz az egy szerződés tárgyát képző határidős kontraktusok száma) 10, a kötési ár (amelyen az opció lehívásakor az határidős kontraktus adásvétele megtörténik) 8,00 EUR.

A határidős kibocsátási egység kontraktussal az Európai Energiatőzsde (MIC XEEE) szabályozott piacán kereskednek, ISIN kódja DE000A0SYVA6

A vételi opció besorolási (CFI) kódja HTFAVC, és az ügylet elszámolása készpénzben történik.

X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés X befektetési vállalkozás	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<Tx> <New> ...
30	Mennyiség	'5'	
33	Árfolyam	'1,00'	

34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	'XXXX'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'XXX CALL OPTION'	...
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<Tx>
46	Árszorzó	'10'	...
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló határidős kontraktus {ISIN} kódja	<Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric>
50	Opció típusa	'CALL'	<Pric>
51	Kötési árfolyam	'8,00'	<MntryVal>
52	Kötési árfolyam pénzneme	'EUR'	<Amt Ccy="EUR">1.00</Amt> </MntryVal>
53	Az opció gyakorlásának típusa	'EURO'	</Pric>
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2018-12-31'	</Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	<FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>XXX CALL OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>OCEFCS</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>10</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>DE000A0SYVA6</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">8.00</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DivryTp>CASH</DivryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

A vételi opció alapterméke a határidős kibocsátási egység kontraktus, ezért a 47. mezőben ennek a határidős kontraktusnak az azonosítója áll.

5.35.9 Összetett ügyletek

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 12. cikkét csak akkor kell alkalmazni, ha a befektetési vállalkozás olyan ügyletet hajt végre, amelyben kettő vagy annál több pénzügyi eszköz vesz részt (összetett ügylet). Ez az ügyletjelentés szempontjából azt jelenti, hogy az ügylet csak akkor tekintendő két vagy annál pénzügyi eszközre kiterjedő ügyletnek, amikor egyetlen egy ügylet jön létre több pénzügyi eszközre párhuzamosan egyetlen egy áron (p. egy db különféle vételi opciókból álló "rövid pillangó ügylet" vétele). Összetett ügylet (pl. stratégiák és strukturált termékek) esetében a példában nem szereplő összes mező kitöltendő, nemcsak azok, amelyek a tényleges lábakhoz tartoznak.

117. példa

X befektetési vállalkozás egy olyan short pillangó stratégiát kíván létrehozni, amelyben két rövid vételi opció 1075 pénzügyi eszközre, egy hosszú vételi opció pedig 2150 pénzügyi eszközre szól. A két eladási és az egy vételi ajánlatot beviszi az Eurex kereskedési rendszerbe, amely azt egy stratégiai ügyletként egyetlen áron hajtja végre.

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés	3. értékközlés
2	Az ügylet referenciaszáma	89127	89128	89129
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	Központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI}	X vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI}
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI}	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
30	Mennyiség	'1075'	'2150'	'1075'
33	Árfolyam	'40'	'40'	'40'
36	Helyszín	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja
40	Összetett ügylet összetevőinek azonosítója	'12345'	'12345'	'12345'

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés	3. jelentés
<Tx> <New> <TxId>89127</TxId>	<Tx> <New> <TxId>89128</TxId>	<Tx> <New> <TxId>89129</TxId>

<pre> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>1075</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="...">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR< /TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</ CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>2150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="...">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR< /TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</ CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPC CPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>1075</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="...">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR< /TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</ CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---	---

118. példa

X befektetési vállalkozás 10 határidős Bund kontraktus ad el az Eurex kötvénypiacon (XEUR), és ezzel párhuzamosan ugyanolyan mennyiséget vesz az alapul szolgáló német államkötvényből. Az ügyletek ezek a lábai egy stratégiai ügyletnek tartoznak (báziskereskedés), és egyetlen 20 eurós áron jönnek létre.

A határidős Bund kontraktus ISIN kódja DE0000000000, míg az alaptermék kötvény ISIN kódja DE0000000001.

Ezt az ügyletet két különálló ügyletjelentésben tanácsos bejelenteni, amelyek külön-külön mutatják a stratégiát alkotó egyik és másik pénzügyi eszközben létrejött ügyletet. A két ügyletjelentést az azonos stratégiához tartozó ügyletjelentésekre vonatkozó egyedi belső kód kapcsolja össze, amelyet a 40. mezőben kell feltüntetni.

Az alább bemutatott ügyletjelentések X vállalkozás szempontjából készültek.

N	Mező	1. értékközlés	2. értékközlés
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	Központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	Központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja
30	Mennyiség	'10'	'1000000'
33	Árfolyam	'20'	'20'
34	Az ár pénzneme	'EUR'	'EUR'
36	Helyszín	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja
40	Összetett ügylet összetevőinek azonosítója	'12345'	'12345'
41	Eszközazonosító kód	{Határidős kötvénykontraktus ISIN kódja}	{Államkötvény ISIN kódja}

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>

<pre> ... <Qty> <Unit>10</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">20</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpnt Id> <Tx> <FinInstrm> <Id>DE0000000000</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Qty> <Unit>1000000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">20</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpnt Id> <Tx> <FinInstrm> <Id>DE0000000001</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	---

6 Iránymutatások a megbízások nyilvántartásához

I. rész – Általános elvek

6.1 A megbízások nyilvántartási követelményeinek hatálya

A 25. cikk (2) bekezdése alapján a megbízások nyilvántartására vonatkozó követelmények a kereskedési helyszínek működtetőire terjednek ki "a rendszereiken keresztül meghirdetett összes megbízást" illetően.

A "megbízásokra" terjednek ki, tehát az aktív, az inaktív, a felfüggesztett, az implicit és a továbbított megbízásokra éppúgy, mint a megbízások módosítására, törlésére és visszautasítására. Érvényesek a fix és a tájékoztató jellegű megbízásokra is.

6.2 Kereskedési helyszín tagjai vagy résztvevői

A MiFID II és a MiFIR számtalan rendelkezésében hivatkozik a kereskedési helyszín "tagjára vagy résztvevőjére". A "kereskedési helyszín" fogalmát a MiFID II 4. cikk (1) bekezdés 24. albekezdése akként határozza meg, hogy az magában foglalja a szabályozott piacot, a multilaterális kereskedési rendszert vagy szervezett kereskedési rendszert. Ugyanakkor pontosítani szükséges, hogy a MiFID II 50. cikke és a MiFIR 25. cikk (2) bekezdése értelmezésében mit jelent a kereskedési helyszín "tagja vagy résztvevője".

A "tag" és a "résztvevő" kifejezések gyakran fordulnak elő a szabályozott piacok és a multilaterális kereskedési rendszerek kapcsán. A MiFID II 16. preambulumbekkezdése pontosítja, hogy a "szabályozott piacok vagy MTF-ek igénybevitelére jogosult személyekre tagokként vagy résztvevőkként lehet hivatkozni. E két kifejezés egymással felcserélhető..."

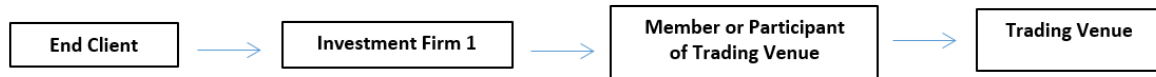
Ugyanakkor a szervezett kereskedési rendszerek (OTF) esetében egy másik módszer érvényesül annak fényében, hogy az MTF-ek és a szabályozott piacok működtetőihez képest az OTF-ek működtetőire az ügyfelekkel való érintkezésben a MiFID II alapján további kötelezettségek hárulnak. Például a MiFID II 18. cikk (7) bekezdése leszögezi, hogy az MTF-ek és az OTF-ek rendelkezzenek "legalább három, ténylegesen aktív taggal vagy felhasználóval". Továbbá a 20. cikk tiltja, hogy az "ügyfelek" megbízásait az OTF az saját eszközeinek terhére hajtsavégre. Mindkét esetben úgy tűnik, hogy amikor egy OTF-ről van szó, a "felhasználó" és az "ügyfél" kifejezés egymással felcserélhető, akár csak a "tag" vagy a "résztvevő" kifejezések.

Tekintve, hogy az OTF-ekre kiterjed a piaci visszaélésekről szóló rendelet hatálya, és mivel a MiFID II/MiFIR követelményeket a kereskedési helyszínek különböző típusainál következetesen szükséges alkalmazni, ezért a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben (megbízások adatainak nyilvántartása) és a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben (órák összehangolása) a "tag illetve a résztvevő" kifejezés az OTF ügyfeleit és felhasználóit is tartalmazza.

6.3 Ügyfél-azonosító kód (3. mező)

Az ügyfél-azonosító kód (3. mező) a tag vagy a résztvevő ügyfelét azonosítja. A 3. mezőben értelemszerűen kizárólag a tag vagy a résztvevő közvetlen ügyfelének jogalany-azonosító (LEI) kódja

vagy {NATIONAL_ID}-ja állhat. Az ügyfél-azonosító kód (3. mező) nyilvántartásának kötelezettsége alapján a kereskedési helyszínen nem köteles nyilvántartásba venni sem a végső ügyfél ügyfél-azonosító kódját, sem a tag vagy résztvevő és a végső ügyfél közötti láncban található közvetítők bármely egyéb ügyfelének ügyfél-azonosító kódját. Az alábbiak a fenti leírást szemléltetik: Az 1. sz. befektetési vállalkozás a kereskedési helyszínen tagjának vagy résztvevőjének az ügyfele..



End client	Végső ügyfél
Investment Firm 1	1. sz. befektetési vállalkozás
Member of Participant of Trading Venue	Kereskedési helyszínen tagja vagy résztvevője
Trading Venue	Kereskedési helyszínen

A kereskedési helyszínek működtetői akkor járnak el helyesen, ha elkérik a tagjuktól vagy résztvevőjüktől a közvetlen ügyfél ügyfél-azonosító kódját, és azt tüntetik fel a 3. mezőben.

Abban az esetben, ha az ügyfél-azonosító kód beszerzése nem történik meg akkor, amikor a megbízást a kereskedési helyszínen működtetőjének benyújtják, a működtető a lehető legrövidebb időn belül, de legkésőbb az ajánlat beadását követő munkanap zárásáig szerezteti azt be.

Az ügyfelek esetében a kereskedési helyszínen kell, hogy ellenőrizze, hogy a megadott azonosító kód hibátlan és teljes.

6.3.1 A 3. mező (ügyfél-azonosító kód) kitöltése összesített megbízások esetén

Ha már megtörtént az allokáció, és az ügyfelek azonosítására még az előtt sor kerül, hogy az ajánlatot végrehajtásra a kereskedési helyszínen tagjához vagy résztvevőjéhez továbbítanak, de a kereskedési helyszínen tagja vagy résztvevője több ügyfél ajánlatát összesíti, akkor a kereskedési helyszínen működtetője a 3. mezőben lehetőleg az alapértelmezett "AGGR" hivatkozást tüntesse fel.

6.3.2 A 3. mező (ügyfél-azonosító kódja) kitöltése, amikor az allokáció még nem történt meg

Abban a kivételes esetben, amikor az allokáció a megbízás benyújtásakor még nem történt meg, és a vonatkozó nemzeti jogszabályok szerint a megbízás annak benyújtása után is allokálható, a kereskedési helyszínen működtetője a 3. mezőben az ilyen megbízás esetén lehetőleg a "PNAL" alapértelmezett hivatkozást tüntesse fel. A kereskedési helyszínen érintett működtetője később nem köteles az ügyfél-azonosító kódját megszerezni, amikor már a megbízásokat egyes ügyfeleknek allokálják.

6.4 Továbbító bróker (6. mező)

A továbbító bróker tevékenysége nem azonos a MiFID II 4. cikk (1) bekezdés 41. albekezdésében meghatározott közvetlen elektronikus hozzáféréssel (DEA). A 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (1) bekezdésének d) pontja a 6. mezővel együtt arról rendelkezik, hogy az ilyen szolgáltatás akkor jön létre, ha egy kereskedési helyszín valamelyik tagja vagy résztvevője (a továbbító bróker) az adott kereskedési helyszín egy másik tagja vagy résztvevője képviselőjében és nevében eljárva juttat el ajánlatot a kereskedési helyszínre.

119. példa

X befektetési vállalkozás a továbbító brókerként eljáró Y vállalkozáson keresztül nyújt be megbízást Z ügyfél nevében M kereskedési helyszínen végrehajtásra.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	X befektetési vállalkozásnak, mint M kereskedési helyszín tagjának a jogalany-azonosító kódja	
2	Közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA)	'false' (hamis)	
3	Ügyfél-azonosító kód	Z természetes személy nemzeti azonosítója	
6	Továbbító bróker	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosítója	
B. szakasz – Kereskedési szerep és likviditásnyújtás			
707	Kereskedési szerep	AOTC	X befektetési vállalkozás Z ügyfél nevében jár el

6.5 A megbízás státusza (33. mező)

A megbízás státusza mezőt üresen kell hagyni törlés, visszautasítás, lejárat és maradéktalan teljesítés esetén, hiszen ilyenkor a megbízás kikerül a kereskedési helyszín ajánlati könyvéből.

6.6 Érvényességi időszak dátuma és időpontja (12. mező)

- i. Az IOC és a FOK megbízások esetében a 12. mező (érvényességi időszak dátuma és időpontja) maradjon üresen (lásd 10. mező – érvényességi időszak). Ez azért van így, mert ezeknek a megbízásoknak a szándék szerint azonnal teljesülniük kell, ahogy az ajánlati könyvben megjelennek (akár maradéktalanul, ahogy a FOK megbízás esetében, vagy a lehetséges maximum mennyiségig az IOC megbízásnál).

- ii. Az "egyéb" kategóriánál az "egyéb" típusú érvényességi időszakok dátuma és időbélyegzője olyan egyéb típusú érvényességi időszakot jelent, amely a 10. mezőben (érvényességi időszak) nincs konkrétan felsorolva. Ilyen esetben a 10. mezőben egy egyedi, négy betűből álló, a konkrét érvényességi időszakot reprezentáló kód álljon, és a 12. mezőt is ki kell tölteni.

6.7 Passzív vagy agresszív megbízás mutatója (44. mező)

Ebbe a mezőbe csak olyan végrehajtás adata kerüljön, amely folyamatos kereskedés közben valósult meg, egyébként a mező maradjon üresen. Ennek az oka az, hogy az aukciós szakaszban a megbízások nem tekinthetők se passzívnak, se agresszívnek.

6.8 A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja (TVTIC) (48. mező)

A 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 12. cikke alapján a kereskedési helyszínek üzemeltetői akkor járnak el helyesen, ha a 48. mező szerinti egyedi "kereskedési helyszín ügyletazonosító kódon" tartanak nyilván a megbízások teljes vagy részleges végrehajtása nyomán létrejött minden egyes ügyletet.

Ezért a kereskedési helyszínek működtetőinek minden esetben meg kell képeznie a "kereskedési helyszín ügyletazonosító kódot" (TVTIC) minden egyes olyan ügyletre, amelyet a kereskedési helyszínükön a rendszereiken keresztül meghirdetett megbízás alapján hajtottak végre. A fenti körülmények esetében a kereskedési helyszín működtetőjének a feladata, hogy a 48. mezőt kitöltve bejelentse az adott TVTIC kódot.

6.9 Sorszám (15. mező)

A sorszám azt hivatott meghatározni, hogy melyik esemény következett be előbb egy adott kereskedési helyszínen olyan esetben, amikor a két esemény időbélyegzője azonos. A kereskedési helyszín feladata gondoskodni arról, hogy a 21. mezőben a tartalom és forma oszlopok alatt felsorolt összes konkrét esemény kapjon sorszámot. A 6.13.9. bekezdésben felsorolt kereskedési szakaszok olyan eseménynek minősülnek, amelyet a 21. mezőben a felsorolt "státusz változása piaci műveletek miatt" kategóriába tartoznak. Ezért a kereskedési helyszínek akkor járnak el helyesen, ha a kereskedési szakaszok változásának sorszámát feltüntetik.

Egyes kereskedési helyszíneken több megbízaspárosító rendszer is működhet a rendszer terhelésének kiegyenlítése érdekében. Ilyen esetben a sorszámnak minden egyes eseményt illetően egyedinek, és az adott megbízaspárosító rendszeren belül következetesnek kell lennie.

Példával az alábbi eseteket szemléltetjük:

1. Olyan hibás használat, ahol a sorszám csak egyetlen ajánlati könyvre nézve egyedi
2. Olyan hibás használat, ahol a sorszám láthatóan megbízásonként egyedi
3. A sorszám helyes használata.

Az alábbi 77. és a 78. példa esetében a kereskedési helyszín egyetlen megbízaspárosító rendszer egynél több ajánlati könyvet tartalmaz, és mindkét ajánlati könyvben több esemény történik.

120. példa Olyan hibás használat, ahol a sorszám csak egyetlen ajánlati könyvre nézve egyedi

Itt nyilvánvaló, hogy a sorszám csak egyetlen ajánlati könyvre nézve egyedi. Ez nem elfogadható, mert az illetékes hatóság képtelen lenne összevonni a több ajánlati könyvben előforduló, de ugyanazon a megbízás párosító rendszeren futó eseményeket. Például: a világos (lit) és a sötét (dark) ajánlati könyvben egyazon pénzügyi eszközben megtörtént események összevonása.

A sorszámok helyesen: 1,2,3,4,5,6,7.

Új ajánlat, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás (21. mező)	Az ajánlati könyv kódja (17. mező)	Az ajánlat azonosító kódja (20. mező)	Sorszám (15. mező)	Dátum és idő
NEWO	1. ajánlati könyv	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z
NEWO	2. ajánlati könyv	GHI	1	2018-03-07T08:30:26.548936Z
CHME	1. ajánlati könyv	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z
NEWO	2. ajánlati könyv	TUV	2	2018-03-07T08:30:26.598731Z
NEWO	1. ajánlati könyv	DEF	3	2018-03-07T08:30:26.975621Z
CAME	1. ajánlati könyv	ABC	4	2018-03-07T08:30:27.025489Z
CAME	1. ajánlati könyv	DEF	5	2018-03-07T08:30:27.025489Z

121. példa Olyan hibás használat, ahol a sorszám láthatóan megbízásonként egyedi

Itt a sorszám egyértelműen megbízásonként és nem az egész megbízás párosító rendszerre nézve egyedi.

A sorszámok helyesen: 1,2,3,4,5.

Új ajánlat, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás (21. mező)	A megbízás azonosító kódja (20. mező)	Sorszám (15. mező)	Dátum és idő (9. mező)	Megjegyzés
NEWO	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z	A sorszám csak a megbízásra nézve egyedi, tehát az adott megbízáshoz tartozó minden egyes eseménnyel nő a sorszám. Ez nem helyes, mert a sorszámnak eseményenként egyedinek, és az összes eseményre nézve következetesnek kell lennie.
CHME	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z	
NEWO	DEF	1	2018-03-07T08:30:26.975621Z	Mivel ez egy másik megbízás, a sorszám visszaáll, és egyről kezdődik.
CAME	ABC	3	2018-03-07T08:30:27.025489Z	
CAME	DEF	2	2018-03-07T08:30:27.025489Z	Az időbélyegző ugyanaz, mint az előző eseménynél. Ugyanakkor, ha az illetékes hatóság növekvő sorrendbe rendezné a sorszámokat, úgy tünne, mintha ez az esemény a közvetlenül felette lévő eseménynél hamarabb következett volna be, de ez nem így van.

122. példa A sorszám helyes használata

Ebben a példában azt feltételezzük, hogy minden esemény ugyanabban az ajánlati könyvben történik, és a kereskedési helyszínen egy megbízaspárosító rendszer működik.

Új ajánlat, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás (21. mező)	A megbízás azonosító kódja (20. mező)	Sorszám (15. mező)	Dátum és idő (9. mező)	Megjegyzés
NEWO	ABC	25897	2018-03-07T08:30:26.548921Z	A sorszámot a kereskedési helyszínen összes ajánlati könyvére képzik. Ezért a sorszám több mint 1-gyel emelkedhet, amikor egy adott ajánlati könyvben vizsgáljuk az eseményeket.
CHME	ABC	26589	2018-03-07T08:30:26.598721Z	A sorszám több mint 1-gyel emelkedett, mert a megbízáspárosító rendszer más ajánlati könyvek eseményeit is feldolgozta, ennek ellenére a sorszámok egyediek, pozitív egész számok emelkedő sorrendben.
NEWO	DEF	26751	2018-03-07T08:30:26.975621Z	
CAME	ABC	27465	2018-03-07T08:30:27.025489Z	
CAME	DEF	27466	2018-03-07T08:30:27.025489Z	Az időbélyegző ugyanaz, mint az előző eseménynél. Ugyanakkor a sorszám alapján az illetékes hatóság el tudja dönteni, hogy ez az esemény a felette levő sorban álló esemény után következett be.

6.10 Érvényességi időszak (10. mező)

6.10.1 Nap végéig érvényes megbízást (DAVY) jelölő címke

123. példa

X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínen nyújt be végrehajtásra nap végéig érvényes megbízást (DAVY) jelölő címkével megbízást 2018. január 16-án

N		Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások			
10	Érvényességi időszak (Validity period)		DAVY
12	Érvényességi időszak dátuma és időpontja		2018-01-16T23:59:59.999999Z

6.10.2 Két érvényességi időszakot jelző címke kombinációja: Adott dátumtól érvényes (GADV) és adott dátumig érvényes (GTDV)

124. példa

X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínen nyújt be végrehajtásra adott dátumtól érvényes (GADV) jelölő címkével megbízást 2018. január 16-án (UTC szerint) 10:05:32.278932-kor. A benyújtás pillanatában az érvényességi időszak GADV, az érvényességi időszak dátuma és időpontja pedig nyilvántartás szerint 2018. január 19. 00:00:00 (a másodperc tört része a MiFID II 50. cikke szerint jelölve) vagy az adott napon a kereskedési helyszínen a kereskedési időszak kezdete legyen (1. esemény). 2018. január 19-én az érvényességi időszak GADV, az érvényességi időszak dátuma és időpontja pedig nyilvántartás szerint 2018. február 13. 23:59:59 legyen (a másodperc tört része a MiFID II 50. cikke szerint jelölve) (2. esemény).

1. esemény: A megbízás benyújtása végrehajtásra

N		Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő		2018-01-16T10:05:32.278932Z
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások			
10	Érvényességi időszak (Validity period)		GADV
12	Érvényességi időszak dátuma és időpontja		2018-01-19T00:00:00.000001Z ³⁶
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			

³⁶ Illetve bármely egyéb a kereskedési kezdete és/vagy a nyitó kereskedési szakasz előtti időbélyegző besűrűsítendő.

21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	NEWO
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
33	A megbízás státusza	INAC ³⁷

2. esemény: A megbízás aktívvá válik

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-01-19T00:00:00.000001Z ³⁸
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
10	Érvényességi időszak	GTDV
12	Érvényességi időszak dátuma és időpontja	2018-02-13T23:59:59.999999Z
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	CHMO ³⁹
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
33	A megbízás státusza	ACTI

6.11 Likviditásnyújtási tevékenység (8. mező)

A kereskedési helyszínek tagjainak vagy résztvevőinek likviditásnyújtási tevékenysége általában az alábbi három forgatókönyv közül az egyiknek a megvalósulása során fordul elő.

- a tag vagy a résztvevő egy árjegyzői stratégia megvalósítása érdekében algoritmikus kereskedést végez, és emiatt a MiFID II 17. és 48. cikke alapján szerződést köt valamelyik kereskedési helyszínnel;
- a (MiFID II 17. cikke szerint nem árjegyzői stratégiának minősülő) likviditásnyújtási tevékenységet végző tag vagy résztvevő saját számlára kereskedik a kibocsátóval vagy a kereskedési helyszínnel kötött megállapodás alapján;
- a likviditásnyújtási tevékenységet végző tag vagy résztvevő ügyfelek nevében hajt végre megbízásokat a kibocsátóval vagy a kereskedési helyszínnel kötött megállapodás alapján.

Az a)-c) pontokban felsorolt likviditásnyújtási tevékenységeknek meg kell jelennie a kereskedési helyszín nyilvántartásában, és ehhez az ügyfelek nevében végrehajtott megbízások esetén megfelelően

³⁷ Amikor a megbízást a kereskedési helyszínre benyújtják, az a GADV érvényességi időszak miatt inaktív státuszú.

³⁸ Illetve bármely egyéb a kereskedési kezdete és/vagy a nyitó kereskedési szakasz előtti időbélyegző besűrűsítő.

³⁹ A megbízás aktívvá válása státuszváltozást jelent a piaci működés miatt.

ki kell tölteni a 7. mezőt (kereskedési szerep), a 8. mezőt (likviditásnyújtás), valamint a 3. mezőt (Ügyfél-azonosító kód).

125. példa

Forgatókönyv	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
Az a) pont szerinti tevékenység	B. szakasz – Kereskedési szerep és likviditásnyújtás	
	7. Kereskedési szerep	DEAL
	8. Likviditásnyújtási tevékenység	'true' (igaz)
A b) pont szerinti tevékenység	B. szakasz – Kereskedési szerep és likviditásnyújtás	
	7. Kereskedési szerep	DEAL
	8. Likviditásnyújtási tevékenység	'true' (igaz)
A c) pont szerinti tevékenység	A. szakasz - A releváns felek azonosítása	
	3. Ügyfél-azonosító kód	{jogalany-azonosító kód} vagy {NEMZETI_AZONOSÍTÓ}
	B. szakasz – Kereskedési szerep és likviditásnyújtás	
	7. Kereskedési szerep	AOTC
	8. Likviditásnyújtási tevékenység	'true' (igaz)

II. Rész – Forgatókönyvek

6.12 Magyarázat

Az adott forgatókönyvben jelzett ellenkező értelmű rendelkezés hiányában az alábbi háttérinformáció a II. részben ismertetett összes forgatókönyvre vonatkozik:

X befektetési vállalkozás (jogalany-azonosító kódja: 12345678901234567890) M kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője.

Y befektetési vállalkozás (jogalany-azonosító kódja: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) egyben M kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője is.

M kereskedési helyszín szegmensazonosító (MIC) kódja 'XMIC'.

M kereskedési helyszínen az átjárók közötti várakozási idő 1 milliszekundumnál rövidebb.

A pénzügyi eszköz ISIN kódja: XX0000000000

A megbízás azonosító kódja: 123456789ABC

M kereskedési helyszínen az ajánlati könyv kódja: XYZ9876

Az M kereskedési helyszín által létrehozott kereskedési helyszín azonosító kód: ABC123456

Emellett a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet-ben a mezőket tartalmazó táblázatban található összes mező kötelező. Mezők csak akkor maradjanak üresen, ha az adott esemény szempontjából nem relevánsak. Például: a 14. mező (nagyság prioritás) nem releváns olyan ajánlati könyv esetében, amely az árfolyamidőnek ad prioritást, ezért a mezőt nem kell kitölteni. Az üzleti esetek csak a pontosítást igénylő mezőkkel foglalkoznak. Az adatszolgáltatás technikai sémájától (pl. XML, CSV stb.) függetlenül, amikor valamelyik mező üresen marad, akkor az információt úgy tanácsos szolgáltatni, hogy az illetékes hatóság meg tudja állapítani, hogy az adott mező üres.

6.13 Központi limitáras ajánlati könyv

A központi limitáras ajánlati könyvre vonatkozó iránymutatások az alábbi forgatókönyvekkel foglalkoznak:

- a) 6.14.1. albekezdés: Új/Törlés/Megbízás módosítása
- b) 6.14.2. albekezdés: Kiegészítő limitár
- c) 6.14.3. albekezdés: Iceberg limitár besorolása
- d) 6.14.4. albekezdés: Peg (vagy kötött) megbízások
- e) 6.14.5. albekezdés: Stop megbízás besorolása
- f) 6.14.6. albekezdés: Továbbított megbízás
- g) 6.14.7. albekezdés: Stratégiai megbízások besorolása
- h) 6.14.8. albekezdés: Prioritás megváltoztatása
- i) 6.14.9. albekezdés: Kereskedési fázisok

6.13.1 Új/Törlés/Megbízás módosítása (21. mező)

6.13.1.1 Új megbízás fogadása

Az első bejelentendő esemény az "Új megbízás" még akkor is, ha a megbízás az ajánlati könyvbe kerülve azonnal teljesül.

126. példa

X befektetési vállalkozás limitáras vételi megbízást nyújt be (1000 részvény vételére 80,00 EUR áron) M kereskedési helyszínen 2018. január 16-án. Az információt M kereskedési helyszíni megbízáspárosító rendszere (UTC szerint) 08:05:32.278932-kor fogadja.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-01-16T08:05:32.278932Z
F. szakasz – A megbízás azonosító kódja		
16	Szegmensazonosító MIC-kód	XMIC
17	Az ajánlati könyv kódja	XYZ9876
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000
19	Az átvétel dátuma	2018-01-16
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	NEWO
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	80,00
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	1000
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	1000
38	Megjelenített mennyiség	1000
39	Kereskedett mennyiség	0

6.13.1.2 Ajánlat módosítása tag vagy résztvevő által

127. példa

X befektetési vállalkozás a fenti megbízáshoz (1000 részvény vétele, ISIN kód XX0000000000 80,00 EUR árfolyamon) M kereskedési helyszínen árfolyammódosítást (81,00 EUR-ra változtatja az árat) nyújt be 2018. január 16-án. A módosítási kérelmet M kereskedési helyszíni megbízáspárosító rendszere (UTC szerint) 14:47:55.179524-kor fogadja. A módosítást X befektetési vállalkozás ügyfele kérte.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		

9	Dátum és idő	2018-01-16T14:47:55.179524Z
F. szakasz – A megbízás azonosító kódja		
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	REME
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	81,00
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	1000
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	1000
38	Megjelenített mennyiség	1000
39	Kereskedett mennyiség	0

6.13.1.3 Részlegesen teljesült megbízás

128. példa

Az 1000 db ISIN XX0000000000 kódú részvényre 81,00 eurón adott módosított megbízás (lásd fenti albekezdés) részlegesen (200 db ISIN XX0000000000 kódú részvényre) teljesül ugyanazon a napon, azaz 2018. január 16-án (UTC szerint) 14:48:11.544378-kor.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-01-16T14:48:11.544378Z
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	PARF
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	81,00
28	Ügyleti ár	81,00
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	1000

37	Maradék mennyiség	800
38	Megjelenített mennyiség	800
39	Kereskedett mennyiség	200
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	ABC123456

6.13.1.4 Maradéktalanul teljesült megbízás

129. példa

A részlegesen teljesült megbízás után megmaradt 800 db ISIN XX0000000000 kódú részvényre szóló 81,00 eurón adott megbízás (lásd fenti albekezdés) ezután maradéktalanul (800 db ISIN XX0000000000 kódú részvényre 81,00 eurón) teljesül ugyanazon a napon, azaz 2018. január 16-án (UTC szerint) 14:50:20.379545-kor.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-01-16T14: 50:20.379545Z
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	FILL
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	81,00
28	Ügyleti ár	81,00
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	1000
37	Maradék mennyiség	0
38	Megjelenített mennyiség	0
39	Kereskedett mennyiség	800
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	ABC789000

6.13.1.5 Megbízás törlése

130. példa

X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínen törlési kérelmet nyújt be egy 2000 db XX0000000000 ISIN kódú részvényre 50,00 eurón tett eladási ajánlatra vonatkozóan 2018. január 18-

án (UTC szerint) 14:12:34-kor A törlési kérelmet M kereskedési helyszínen megbízaspárosító rendszere (UTC szerint) 14:12:34.112856-kor fogadja. A megbízás törlését X befektetési vállalkozás ügyfele kérte.

N		Mező		A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-01-18T14:12:34.112856Z		
F. szakasz – A megbízás azonosító kódja				
20	A megbízás azonosító kódja	987654321ABC		
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események				
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	CAME		
H. szakasz – Megbízás típusa				
22	A megbízás típusa	Limit		
23	A megbízástípus besorolása	LMTO		
I. szakasz – Árak				
24	Limitár	50,00		
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók				
32	Vétel / eladás mutató	SELL		
33	A megbízás státusza ⁴⁰			
36	Kezdeti mennyiség	2000		
37	Maradék mennyiség	0		
38	Megjelenített mennyiség	0		
39	Kereskedett mennyiség	0		

6.13.2 Kiegészítő limitár (25. mező)

131. példa

M kereskedési helyszínen a záró kereskedési szakaszban lehetőséget biztosít limitáras megbízások benyújtására olyan limitáron, amely megegyezik a maximális vételi vagy a minimális eladási árfolyammal, és emellett a megbízás tartalmazhat egy a minimális vételi vagy a maximális eladási árfolyammal azonos kiegészítő limitárat is. M kereskedési helyszínen az ilyen típusú megbízást aktív megbízásként kezeli függetlenül attól, hogy az értékpapír árfolyama esetleg a maximum és a minimum által meghatározott sávon kívül esik. M kereskedési helyszínenre vételi megbízás érkezik 100 EUR maximális vételáron, és a megbízás tartalmaz egy kiegészítő minimális vételárat is 95 eurón.

⁴⁰ Ez a mező a 6.5. bekezdés alapján üres maradhat.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Strike Match	A helyszín saját meghatározása szerint.
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	100	
25	Kiegészítő limitár	95	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
33	A megbízás státusza	ACTI	A megbízás a záró kereskedési szakasz alatt érvényes, de csak akkor teljesül, ha az egyensúlyi ár 95 és 100 EUR közötti.

6.13.3 Iceberg limitár besorolása

132. példa

2018. március 7-én (UTC szerint) 10:10:32.652758-kor X befektetési vállalkozás Iceberg limitáras vételi megbízást nyújt be végrehajtásra M kereskedési helyszínen. A megbízás 100,00 EUR árfolyamon összesen 150 db részvény vételére szól. Alceberg megbízás beállítása alapján az ajánlati könyvben 50 db részvény jelenik meg, a további 100 db részvény a piaci szereplők elől rejtve marad (1. esemény).

A Iceberg megbízásnak a piac számára látható teljes mennyisége (50 db részvény) negyven másodperccel azután teljesül, hogy a megbízás megjelenik az ajánlati könyvben (2. esemény).

A Iceberg megbízás részleges végrehajtása után a piac számára látható rész ismét azonnal feltöltődik. Ebben az esetben M kereskedési helyszínen a rövid várakozási időnek megfelelő 3 mikroszekundum adódik hozzá az időhöz (3. esemény).

1. esemény a megbízás bekerül az ajánlati könyvbe

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			

13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO	
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	2	M kereskedési helyszín saját besorolása szerint
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	100,00	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	150	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	150	
38	Megjelenített mennyiség	50	

2. esemény: az Iceberg megbízás teljes látható mennyisége teljesül

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:10:46.652785Z	Az ügylet 14 másodperccel az ajánlati könyvbe való bevitel után jön létre
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:10:32.652785Z	<i>Nincs változás.</i>
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás,	PARF	Az ajánlat részlegesen teljesül

	részleges vagy teljes végrehajtás		
I. szakasz – Árak			
28	Ügyleti ár	100,00	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	150	<i>Nincs változás</i>
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	100	
38	Megjelenített mennyiség	0	A látható mennyiség feltöltését a következő eseménynél helyes bemutatni
39	Kereskedett mennyiség	50	
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	ABC123456	

3. esemény: az Iceberg megbízás látható mennyisége feltöltődik

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:10:46.652788Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:10:46.652788Z	Amikor az Iceberg megbízás feltöltődött, (a feltöltés dátumának és időpontjának megfelelő) új időbélyegzővel kerül a sorba.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	REMA	Piaci műveletek következtében felváltott (automatikus).
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	150	<i>Nincs változás</i>
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	100	<i>Nincs változás</i>

38	Megjelenített mennyiség	50	
----	-------------------------	----	--

6.13.4 Peg (vagy kötött) megbízások⁴¹

133. példa

2018. március 7-én (UTC szerint) 10:10:32.652785-kor a befektetési vállalkozás peg ajánlatot nyújt be végrehajtásra M kereskedési helyszínen. A megbízás benyújtásakor a kereskedő az alábbiakat határozza meg:

- A mennyiség 150 db és láthatatlan mennyiség nincs;
- A megbízás a kereskedési helyszínen elérhető legjobb vételi ajánlathoz van kötve.
- Az ajánlat beállítása szerint a maximum 100,10 EUR vételi árfolyamhoz van kötve (azaz 110,10 EUR-nál magasabb vételi árfolyam esetén a peg megbízás a 100,10 eurós limiten marad).

M kereskedési helyszín a peg megbízást az alábbiak szerint kezeli:

Az ajánlat a legalacsonyabb prioritást kapja a sorban;

Az ajánlat 50 ms várakozási idő után kötődik a legjobb vételi árfolyamhoz⁴².

Az ajánlati könyv státusza⁴³ a megbízás M kereskedési helyszínre történő benyújtása előtt

VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100
100	99,75	100,20	100

1. esemény a megbízás bekerül M kereskedési helyszín ajánlati könyvébe

⁴¹ Ebben a példában a kötött megbízás egy bizonyos mennyiségű értékpapírnak a látható árfolyamon történő megvételére vagy eladására szóló limitáras megbízás, de a látható árfolyam beállítása szerint a kereskedési helyszín ajánlati könyvében egy árpontot követ.

⁴² Ez a várakozás minden olyan kereskedési helyszínen technikai szükségszerűség, amely kötött típusú megbízást befogad (ezt az információt nem szokták nyilvánosságra hozni).

⁴³ Minden egyes alább bemutatott táblázatban a két baloldali oszlop ("VÉTEL") mutatja a részvényre vonatkozóan az ajánlati könyvbe már bevitt vételi ajánlatokat, míg a két jobboldali oszlop ("ELADÁS") a részvényre vonatkozóan már a könyvben levő eladási ajánlatokat tartalmazza.

M kereskedési helyszín ajánlati könyvének státusza a megbízás bevétele után

VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
250	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100
100	99,75	100,20	100

M kereskedési helyszín ajánlati könyve alapján a benyújtott peg megbízás a legjobb áron (99,99 EUR kezdő limit áron) csatlakozik a többi ajánlathoz.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:10:32.652785Z		
E. szakasz – Prioritás és sorszám				
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:10:32.652785Z		Az ajánlat a legalacsonyabb prioritást kapja a sorban. A prioritási időbélyegzőket azonban fel kell tüntetni, hogy el lehessen dönteni, hogy a különböző peg megbízások közül melyik kap elsőbbséget.
F. szakasz – A megbízás azonosítása				
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC		
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események				
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO		
H. szakasz – Megbízás típusa				
22	A megbízás típusa	P		M kereskedési helyszín saját besorolása szerint
23	A megbízástípus besorolása	LMTO		A peg megbízás olyan limitáras megbízás, amelyben a limitár automatikusan változik
I. szakasz – Árak				
24	Limitár	99,99		

27	Referencia-limitár	100,10	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	150	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	150	
38	Megjelenített mennyiség	150	Nincs rejtett mennyiség

2. esemény: a peg megbízás limitára megváltozik, amikor új megbízás kerül az ajánlati könyvbe

UTC szerint 10:10:45.685975-kor 100,00 árfolyamon 200 db részvény vételére szóló napi megbízás lép az ajánlati könyvbe. Az ajánlatból nem jön létre ügylet, és az ajánlati könyvben továbbra is látható. Ezért 50 milliszekundum elteltével a peg megbízás limitára a legutoljára bevitt ajánlat limitárához igazodik.

M kereskedési helyszín ajánlati könyvének státusza

VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
350	100,00	100,03	100
100	99,99	100,05	100
100	99,98	100,08	100
100	99,95	100,10	100
100	99,90	100,15	100
100	99,80	100,20	100
100	99,75		

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:10:45.735975 Z		50 milliszekundum várakozás után az ajánlat árfolyama a bevitt új ajánlatéhoz igazodik
E. szakasz – Prioritás és sorszám				
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:10:32.735975Z		Változatlan.
F. szakasz – A megbízás azonosítása				
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC		

G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	REMA	Piaci műveletek következtében felváltva. A peg megbízás limitárát M kereskedési helyszín rendszere automatikusan módosítja
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	100,00	A limitár az új legjobb vételi ajánlathoz igazodik
27	Referencia-limitár	100,10	Változatlan

3. esemény: új limitáras vételi megbízás lép be az ajánlati könyvbe, 100,15 EUR árfolyamig jön létre belőle ügylet, de nem teljesül maradéktalanul

UTC szerint 10:10:59.256789-kor 600 db részvényre szóló napi limitáras vételi megbízás kerül 100,15 EUR árfolyamon az ajánlati könyvbe. Ebből a megbízásból 100 db részvény teljesül 100,03 EUR, 100,05 EUR, 100,08 EUR, 100,10 EUR és 100,15 EUR árfolyamon. A maradék mennyiség (100 db) az ajánlati könyvben marad. Az utolsó végrehajtás után 50 milliszekundummal a peg megbízás limitára a piaci műveletek miatt 100,00 EUR-ról 100,10 EUR-ra módosul, de annál magasabbra nem emelkedhet, mert azt a kereskedő 100,10 EUR szinten korlátozta.

M kereskedési helyszín ajánlati könyvének státusza

VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	100,15	100,20	100
150	100,10		
200	100,00		

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:10:59.306789Z		Az utolsó végrehajtás után 50 milliszekundummal
E. szakasz – Prioritás és sorszám				
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:10:32.652785Z		Változatlan
F. szakasz – A megbízás azonosítása				

20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	REMA	Piaci műveletek következtében felváltva. A peg megbízás limitárát M kereskedési helyszín rendszere automatikusan módosítja
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	100,10	A limitár 100,10 euróra van korlátozva (a 27. mezőben megadottak szerint)
27	Referencia-limitár	100,10	<i>Változatlan</i>

6.13.5 Stop megbízás besorolása

134. példa

2018. március 7-én (UTC szerint) 10:05:32.652785-kor egy befektetési vállalkozás stop vételi megbízást nyújt be 150 db részvény pénzügyi eszközre M kereskedési helyszínen. A megbízás beállítása szerint akkor teljesülhet, ha a részvény piaci árfolyama eléri vagy meghaladja a 100,02 eurót. Amikor a megbízást a kiváltó esemény aktiválja, az átalakul:

- A. változat: (limitár nélküli) piaci megbízássá, illetve;
- B. változat: (101,00 EUR limitáron) limitáras megbízássá.

A megbízás érvényességi időszaka alapján visszavonásig érvényes, azaz aktiválódásáig illetve törléséig az ajánlati könyvben marad.

1. esemény a megbízás bekerül M kereskedési helyszín ajánlati könyvébe

A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok			
N	Mező		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:05:32.652785Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:05:32.652785Z	Mivel a megbízás szinte ebben a pillanatban lépett be az ajánlati könyvbe, a prioritási időbélyegző a bevétel dátumával és időpontjával azonos. A STOP megbízás prioritási időbélyegzőjét a többi STOP megbízáshoz képest kell értékelni

F. szakasz – A megbízás azonosító kódja			
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO	
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	A. változat szerint 4 és B. változat szerint S	M kereskedési helyszín saját besorolása szerint
23	A megbízástípus besorolása	STOP	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	A. változat szerint [üresen marad] és B. változat szerint 101,00	
26	Stop ár	100,02	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
33	A megbízás státusza	INAC	
36	Kezdeti mennyiség	150	

2. esemény: az egyik piaci résztvevő 20 db részvényt vesz 100,02 EUR árfolyamon M kereskedési helyszínen, ezzel aktiválja a Stop megbízást

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:5:55.652785Z	A kiváltó eseményre 23 másodperccel azután kerül sor, hogy a kereskedési helyszín ajánlati könyve befogadja a stop megbízást.
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások			
10	Érvényességi időszak (Validity period)	IOCV	IOC megbízás (Immediate-or-Cancel – „most rész”)

G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	TRIG	Kiváltott
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	A. változat szerint 4 B. változat szerint S	A kiváltás után az ajánlat típusa változatlan marad, de besorolása (23. mező) megváltozik
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	A kiváltott stop megbízást limitáras megbízásként kell besorolni
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	<u>A. változat</u> szerint [üresen marad] valamint <u>B. változat</u> szerint 101,00	
26	Stop ár	100,02	A stop ár annak ellenére szerepel továbbra is, hogy nem kell figyelembe venni, miután a 33. mezőben a státusz "ACTI" értékre vált
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ACTI	Amikor a stop megbízás kiváltása megtörténik, státusza "aktívra" vált.

6.13.6 Továbbított megbízás

135. példa

2018. március 7-én (UTC szerint) 10:05:32-kor X befektetési vállalkozás limitáras vételi megbízást nyújt be végrehajtásra M kereskedési helyszínen. A megbízás 100,02 EUR árfolyamon összesen 150 db részvény vételére szól. Amikor a kereskedő M kereskedési helyszínen benyújtja a megbízását, azt határozza meg, hogy irányítsák más kereskedési helyszínre a megbízást, amennyiben azt M kereskedési helyszínen nem lehet akár maradéktalanul (A. változat), akár részlegesen (B. változat) végrehajtani. Továbbításra mindkét változatban sor kerül, tehát a megbízás teljes lekötetlen mennyiségét (A. változat) vagy annak maradék mennyiségét (B. változat) N kereskedési helyszínre irányítják át.

A továbbított megbízást N kereskedési helyszín részlegesen végrehajtja. Az N kereskedési helyszínen létrejött ügyletet M kereskedési helyszín rendszerein is rögzíteni kell.

A kereskedő mindkét változatra nézve azt is meghatározza, hogy amennyiben az ajánlat nem hajtható végre maradéktalanul N kereskedési helyszínen, akkor az kerüljön vissza M kereskedési helyszínre. Ezért miután N kereskedési helyszínen megtörténik a részleges végrehajtás, a megbízás ismét M kereskedési helyszín ajánlati könyvében kerül aktív státuszba.

A megbízásnak M kereskedési helyszínről N kereskedési helyszínre való továbbítása érdekében Z befektetési vállalkozás, mint N kereskedési helyszín tagja közvetlen elektronikus hozzáférési szolgáltatást nyújt.

Az ajánlati könyvek státusza⁴⁴ mielőtt a megbízás beérkezik M kereskedési helyszínre

Az ajánlati könyv státusza M kereskedési helyszínen, ahova a megbízás eredetileg beérkezik

Az ajánlati könyv státusza N kereskedési helyszínen, ahova a megbízást továbbítják

VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100

VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	99,99	100,01	100
100	99,98	100,03	100
100	99,95	100,04	100
100	99,90	100,05	100
100	99,80	100,08	100

1. esemény a megbízás bekerül M kereskedési helyszín ajánlati könyvébe

M kereskedési helyszín ajánlati könyvének státusza a megbízás bevétele után

VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
150	100,02	100,03	100
100	99,99	100,05	100
100	99,98	100,08	100
100	99,95	100,10	100
100	99,90	100,15	100
100	99,80		

M kereskedési helyszín ajánlati könyve alapján a benyújtott limitáras megbízás nem teljesülhet (egyáltalán nem párosítható a másik oldallal).

A megbízást M kereskedési helyszín nyilvántartásaiban új megbízásként helyes szerepeltetni (lásd 6.13.1. bekezdés). Továbbá (maximum 50 karakter hosszú) alfanumerikus szöveggel helyes kitölteni a továbbítási stratégiát (47. mező) az M kereskedési helyszín meghatározása szerint.

⁴⁴ Minden egyes alább bemutatott táblázatban a két baloldali oszlop ("VÉTEL") mutatja a részvényre vonatkozóan az ajánlati könyvbe már bevitt vételi ajánlatokat, míg a két jobboldali oszlop ("ELADÁS") a részvényre vonatkozóan már a könyvben levő eladási ajánlatokat tartalmazza. Az iránymutatások értelmezésében mindegyik limitáras megbízás kizárólag egy megbízást takar.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
47	Továbbítási stratégia	ROUTING_TO_TV_N_ONLY	Az M kereskedési helyszín meghatározása szerint (maximum 50 karakter hosszú) alfanumerikus szöveg

2. esemény: a megbízást N kereskedési helyszínre továbbítják

A. változat szerint

Tekintve, hogy M kereskedési helyszínen nem lehet a megbízást 100,02 EUR árfolyamon az ajánlati könyvbe való beérkezés után teljesíteni, azt a rendszer N kereskedési helyszínre továbbítja a kereskedő által adott utasítás alapján. Ezért a megbízás kikerül M kereskedési helyszín ajánlati könyvéből. Ha azonban a megbízás N kereskedési helyszínen sem teljesülhet, a lekötetlen mennyiség a kereskedő eredeti utasításai szerint visszatér M kereskedési helyszín ajánlati könyvébe.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:05:32.652788Z	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	CHMO	"A státusz megváltozása piaci művelet következtében"
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ROUT	A megbízást N kereskedési helyszínre továbbítják
36	Kezdeti mennyiség	150	<i>Nincs változás</i>
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	150	A mezőben a másik kereskedési helyszínre továbbított mennyiség áll
38	Megjelenített mennyiség	0	A megbízásnak a másik kereskedési helyszínre továbbított mennyisége ez idő alatt M kereskedési helyszínen nem látható.

B. változat szerint

A megbízás M kereskedési helyszínen részlegesen teljesült (25 db részvényt megvettek), majd a (125 db részvényből álló) fennmaradó mennyiséget a rendszer N kereskedési helyszínre továbbította. A megbízásnak részleges eseményt követő továbbítását M kereskedési helyszín nyilvántartása az alábbi mezőkben rögzíti.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ROUT	A megbízást N kereskedési helyszínre TOVÁBBÍJTJÁK
36	Kezdeti mennyiség	150	<i>Nincs változás</i>
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	125	Itt a 25 db részvény megvétele után M kereskedési helyszínen még végrehajtásra váró mennyiség áll
38	Megjelenített mennyiség	0	A megbízásnak a másik kereskedési helyszínre továbbított mennyisége ez idő alatt M kereskedési helyszínen nem látható
39	Kereskedett mennyiség		A 25 db részvény vétele egy korábbi eseményben rögzül

A következő táblázat azt mutatja be, hogyan jelenik meg az M kereskedési helyszínről továbbított megbízás N kereskedési helyszín nyilvántartásában.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	Az N kereskedési helyszínen tag Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító (LEI) kódja, aki a megbízást M kereskedési helyszín nevében továbbítja	
2	Közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA)	'true' (igaz)	
3	Ügyfél-azonosító kód	M kereskedési helyszín jogalany-azonosító (LEI) kódja	Ebben az esetben M kereskedési helyszín N kereskedési helyszín

			tagjának (Z befektetési vállalkozásnak) az ügyfele Amennyiben még egy közvetítő ékelődne be, akkor ebben a mezőben nem szabad M kereskedési helyszín jogalany-azonosító kódját feltüntetni.
B. szakasz – Kereskedési szerep és likviditásnyújtás			
7	Kereskedési szerep	AOTC	X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszín nevében jár el
F. szakasz – A megbízás azonosító kódja			
16	Szegmensazonosító MIC-kód	N kereskedési helyszín szegmensazonosító (MIC) kódja	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO	
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	IOC_ORDER	N kereskedési helyszín saját besorolása szerint
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	A. változat szerint 150 valamint B. változat szerint 125	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	A. változat szerint 150 és B. változat szerint 125	

3. esemény: az N kereskedési helyszín ajánlati könyvébe beérkező megbízás részlegesen teljesül

A megbízás N kereskedési helyszín nyilvántartásában részlegesen teljesült megbízásként szerepeljen (lásd 6.13.1.4. bekezdés). Emellett a 48. mezőt az alábbiak szerint helyes kitölteni:

		A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	
N	Mező		Leírás (értelemszerűen)
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	DEF54321	

A. változat szerint

Miután a megbízás beérkezik N kereskedési helyszínen ajánlati könyvébe, ott 100 db részvényt megvesznek. Ezt az N kereskedési helyszínen létrejött vételt M kereskedési helyszínen nyilvántartásaiban az eredeti megbízáshoz kapcsolva kell feltüntetni.

A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok			
N	Mező		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:05:32.662788Z	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	PARF	Az ajánlat részlegesen teljesül
I. szakasz – Árak			
28	Ügyleti ár	100,01	Az ajánlat N kereskedési helyszínen 100.01-en részlegesen teljesült
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ROUT	<i>Nincs változás</i>
36	Kezdeti mennyiség	150	<i>Nincs változás</i>
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	50	
38	Megjelenített mennyiség	0	Mivel a megbízás státusza még mindig "továbbított".
39	Kereskedett mennyiség	100	
48	A kereskedési helyszínen ügyletazonosító kódja		Ezt a mezőt nem szabad üresen hagyni, mert az ügyletet nem M kereskedési helyszínen hajtotta végre.

B. változat szerint

Az N kereskedési helyszínen történő továbbítás előtt a megbízást M kereskedési helyszínen részlegesen (25 db részvény erejéig) végrehajtja. Ezért az N kereskedési helyszínen továbbított megbízás csak 125 db részvényre vonatkozik. Az N kereskedési helyszínen beérkező megbízás (100 db részvény vételével) részlegesen teljesül.

Az N kereskedési helyszínen létrejött ügyletet M kereskedési helyszínen nyilvántartásaiban a fenti táblázatban bemutatott módon kell rögzíteni, az alábbi mezők azonban eltérnek.

N Mező		A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	PARF	Az ajánlat részlegesen teljesül
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ROUT	
36	Kezdeti mennyiség	150	B. változat szerint nem változik az eredeti mennyiség
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	25	25 db részvény vételére az M kereskedési helyszínen már a megbízás továbbítása előtt sor került.
38	Megjelenített mennyiség	0	
39	Kereskedett mennyiség	100	
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja		Ezt a mezőt nem szabad üresen hagyni, mert az ügyletet nem M kereskedési helyszínen hajtotta végre.

4. esemény a továbbított megbízás státusza ismét aktívra vált M kereskedési helyszínen ajánlati könyvében

N Mező		A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó standardok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:05:32.662791Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:05:32.662791Z	A megbízás elvesztette prioritási időbélyegzőjét, amikor N kereskedési helyszínen továbbították. A prioritási időbélyegző azt az időpontot mutatja, amikor a megbízás visszaérkezik M

			kereskedési helyszín ajánlati könyvébe.
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	CHMO	"A státusz megváltozása piaci művelet következtében"
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	100,02	<i>Nincs változás</i>
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ACTI	Ebben a változatban a megbízás státusza M kereskedési helyszín ajánlati könyvében aktívra vált.
36	Kezdeti mennyiség	150	<i>Nincs változás</i>
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	A. változat szerint 50 és B. változat szerint 25	
38	Megjelenített mennyiség	A. változat szerint 50 és B. változat szerint 25	

6.13.7 Stratégiai megbízások besorolása (46. mező)

Beimplikáló funkció

136. példa

X befektetési vállalkozás megbízása

X befektetési vállalkozás a júliusban lejáró opcióra (225-ös kötési áron) kíván M kereskedési helyszínen megbízást bevinni. 2018. március 10-én (UTC szerint) 10:07:16.523871-kor X befektetési vállalkozás sima megbízást visz be júliusi lejáratra 200 db vételi opció vételére 225-ös kötési áron és 13 EUR áron. M kereskedési helyszínen a júliusi vételi opció ajánlati könyv szerinti kódja 256718, ISIN kódja pedig XX1234567890.

Y befektetési vállalkozás megbízása

Egy másik befektetési vállalkozás (Y vállalkozás) az augusztusi opciós lejáratra kíván (225-ös kötési áron) M kereskedési helyszínen megbízást bevinni. 2018. március 7-én (UTC szerint) 10:09:38.981242-kor Y befektetési vállalkozás sima megbízást visz be augusztusi lejáratra 100 db vételi opció eladására 225-ös kötési áron és 15,5 EUR áron. M kereskedési helyszínen a júliusi vételi opció ajánlati könyv szerinti kódja 256735, ISIN kódja pedig XXABCDEFGHIJ.

Implikált megbízás – Opciós naptári különbözeti ügylet

M kereskedési helyszín implikált megbízási funkciója azt jelenti, hogy két sima megbízás egy implikált megbízást hoz létre az opciós naptári ügylet stratégiában. Ez az implikált megbízás 100 db július-augusztusi FCAL 2,5 eurón történő eladására szól. A megbízást a rendszer az adatcsatornán keresztül

terjeszti a piacon. M kereskedési helyszínen a július-augusztusi FCAL 225 ajánlati könyv szerinti kódja 256786.

Z befektetési vállalkozás megbízása

Z befektetési vállalkozás, amelynek a jogalany-azonosító kódja KLMNOPQRST1234567890, ugyanarra az opciós naptári különbözeti ügyletre kíván megbízást bevinni. 2018. március 7-én (UTC szerint) 10:09:56.684251-kor Z befektetési vállalkozás a naptári különbözeti ügyletre 100 db július-augusztusi FCAL 225-re szóló megbízást visz be 2,5 EUR áron. M kereskedési helyszínen a július-augusztusi FCAL 225 ajánlati könyv szerinti kódja 256786. Ezt a megbízást a rendszer a fenti implikált megbízás ellenében azonnal végrehajtja.

1. esemény: X befektetési vállalkozás megbízása beérkezik az ajánlati könyvbe

Az ajánlati könyv státusza⁴⁵ a megbízás beérkezése után (az új megbízás piros színnel kiemelve)

Júliusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Augusztusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	15,25	16,50	100
100	15,20	16,55	100
100	15,15	16,65	100

Július-augusztusi FCAL 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	2,00	5,25	100

A 225-ös júliusi vételi opció esetében: X befektetési vállalkozás sima megbízása 200 db júliusi vételi opció vételére szól 225-ös kötési áron és 13 EUR áron. M kereskedési helyszínen a 225-ös júliusi vételi opció ajánlati könyv szerinti kódja 256718. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja:

⁴⁵ Minden egyes alább bemutatott táblázatban a két baloldali oszlop ("VÉTEL") mutatja az ajánlati könyvbe már bevitt vételi ajánlatokat, míg a két jobboldali oszlop ("ELADÁS") a már a könyvben levő eladási ajánlatokat tartalmazza. Az iránymutatások értelmezésében minden egyes árszínhez kizárólag egyetlen megbízás tartozik.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	12345678901234567890	
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:07:16.523871Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:07:16.523871Z	Mivel a megbízás szinte ebben a pillanatban lépett be az ajánlati könyvbe, a prioritási időbélyegző a bevitel dátumával és időpontjával azonos
15	Sorszám	3758945	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256718	
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX1234567890	
20	A megbízás azonosító kódja	Xj26F458s	A kereskedési helyszín egyedi ajánlati kódja.
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO	Az első bejelentendő esemény az "Új megbízás" még akkor is, ha a megbízás az ajánlati könyvbe kerülve azonnal teljesül
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Limit	A kereskedési helyszín saját besorolása szerint
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	13	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	200	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	200	
38	Megjelenített mennyiség	200	
46	Stratégiához kapcsolt megbízás azonosítása		Üres, mert még nincs végrehajtva.

2. esemény: Y befektetési vállalkozás megbízása beérkezik az ajánlati könyvbe

Az ajánlati könyv státusza⁴⁶ a megbízás beérkezése után (az új megbízás piros színnel kiemelve)

Júliusi vétel 225-ön				Augusztusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS		VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség	Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
200	13,00	13,25	100	100	15,25	15,50	100
100	11,25	13,30	100	100	15,20	16,50	100
100	11,20	13,35	100	100	15,15	16,55	100
100	11,15					16,65	100

Július-augusztusi FCAL 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	2,00	5,25	100

A 225-ös júliusi vételi opció esetében: Y befektetési vállalkozás sima megbízása 100 db júliusi vételi opció eladására szól 225-ös kötési áron és 15,5 EUR áron. M kereskedési helyszínen a 225-ös júliusi vételi opció ajánlati könyv szerinti kódja 256735. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	ABCDEFGHIJKLMNQRST	
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Mivel a megbízás szinte ebben a pillanatban lépett be az ajánlati könyvbe, a prioritási időbélyegző

⁴⁶ Minden egyes alább bemutatott táblázatban a két baloldali oszlop ("VÉTEL") mutatja az ajánlati könyvbe már bevitt vételi ajánlatokat, míg a két jobboldali oszlop ("ELADÁS") a már a könyvben levő eladási ajánlatokat tartalmazza. Az iránymutatások értelmezésében minden egyes árszínhez kizárólag egyetlen megbízás tartozik.

			a bevétel dátumával és időpontjával azonos
15	Sorszám	3758946	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256735	A kereskedési helyszín ajánlati könyvének kódja.
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XXABCDEFGHIJ	
20	A megbízás azonosító kódja	Xj26F459n	M kereskedési helyszín egyedi ajánlati kódja.
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO	Az első bejelentendő esemény az "Új megbízás" még akkor is, ha a megbízás az ajánlati könyvbe kerülve azonnal teljesül
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Limit	M kereskedési helyszín saját besorolása szerint.
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	15,5	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	100	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	100	
38	Megjelenített mennyiség	100	
46	Stratégiahoz kapcsolt megbízás azonosítása		Üres, mert még nincs végrehajtva.

3. esemény: Az implikált megbízás bekerül az ajánlati könyvbe

Július-augusztusi FCAL 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	2,00	2,50	100
		5,25	100

Júliusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Az

Augusztusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	100

ajánlati könyv státusza ⁴⁷ az implikált megbízás beérkezése után (az új megbízás piros színnel kiemelve)

A 225-ös július-augusztusi FCAL ajánlati könyve esetében: M kereskedési helyszín implikált megbízást állít elő az X és az Y befektetési vállalkozás által bevitt két sima megbízásból a júliusi és az augusztusi vételi opciókkal kapcsolatosan. Ez az implikált megbízás 100 db július-augusztusi FCAL 2,5 eurón történő eladására szól. M kereskedési helyszínen a 225-ös július-augusztusi FCAL ajánlati könyv szerinti kódja 256786. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja. Az 1., 2., 3., 4., 5., 6., 7. és 8. mező mindig üresen marad, mert ez egy implikált megbízás, amelyet a kereskedési helyszín és nem egy tagja/résztevő hozott létre.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Mivel a megbízás szinte ebben a pillanatban lépett be az ajánlati könyvbe, a prioritási időbélyegző a bevétel dátumával és időpontjával azonos
15	Sorszám	3758947	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256786	M kereskedési helyszín ajánlati könyvének kódja.
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX1234567890, XXABCDEFGHJI	Mivel a strtégiák nem pénzügyi eszközök, nincs ISIN számuk, így a stratégia részét képező ISIN-ek lettek megadva.

⁴⁷ Az iránymutatások értelmezésében minden egyes árszinthez kizárólag egyetlen megbízás tartozik.

20	A megbízás azonosító kódja	Xj26F460g	M kereskedési helyszín egyedi ajánlati kódja.
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO	Az első bejelentendő esemény az "Új megbízás" még akkor is, ha a megbízás az ajánlati könyvbe kerülve azonnal teljesül
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Implikált	A kereskedési helyszín saját besorolása szerint.
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	2,5	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	
33	A megbízás státusza	IMPL	Azt jelzi, hogy ez a sima megbízásokból létrejött implikált megbízás.
36	Kezdeti mennyiség	100	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	100	
38	Megjelenített mennyiség	100	
46	Stratégiához kapcsolt megbízás azonosítása		Üres, mert még nincs végrehajtva.

4. esemény: Z befektetési vállalkozás megbízása beérkezik az ajánlati könyvbe

Az ajánlati könyvek státusza (az új megbízás pirossal kiemelve)

Júliusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Augusztusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	

Július-augusztusi FCAL 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	2,50	2,50	100

100	2,00	5,25	100
-----	------	------	-----

A 225-ös július-augusztusi FCAL esetében: Z befektetési vállalkozás naptári különbözeti ügyletre szóló megbízásának tárgya 100 db július-augusztusi FCAL 2,5 eurón történő eladása. M kereskedési helyszínen a 225-ös júliusi-augusztusi FCAL ajánlati könyv szerinti kódja 256786. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	KLMNOPQRST1234567890	
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Mivel a megbízás szinte ebben a pillanatban lépett be az ajánlati könyvbe, a prioritási időbélyegző a bevétel dátumával és időpontjával azonos
15	Sorszám	3759523	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256786	M kereskedési helyszín ajánlati könyvének kódja.
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX1234567890, XXABCDEFGHJIJ	Mivel a stratégiák nem pénzügyi eszközök, nincs ISIN számuk, így a stratégia részét képező ISIN-ek lettek megadva.
20	A megbízás azonosító kódja	Xj26H127c	M kereskedési helyszín egyedi ajánlati kódja.
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO	Az első bejelentendő esemény az "Új megbízás" még akkor is, ha a megbízás az ajánlati könyvbe kerülve azonnal teljesül
H. szakasz – Megbízás típusa			

22	A megbízás típusa	Limit	M kereskedési helyszín saját besorolása szerint
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	2,5	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
33	A megbízás státusza	ACTI	
36	Kezdeti mennyiség	100	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	100	
38	Megjelenített mennyiség	100	
46	Stratégiához kapcsolt megbízás azonosítása		Üres, mert még nincs végrehajtva.

5. esemény: Végrehajtás a naptári különbözeti ügyletek ajánlati könyvében és sima szerződésekre vonatkozó megbízások változásai

Az ajánlati könyv státusza⁴⁸ a végrehajtás időpontjában

⁴⁸ A narancs színnel kiemelt megbízások végrehajtása történik meg, és emiatt frissülnek a kézzel kiemelt megbízások valamint a lilával jelölt megbízás teljes végrehajtása is.

Júliusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	13,00	13,00	100
100	11,25	13,25	100
100	11,20	13,30	100
100	11,15	13,35	100

Augusztusi vétel 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	15,50	15,50	100
100	15,25	16,50	100
100	15,20	16,55	100
100	15,15	16,65	100

Július-augusztusi FCAL 225-ön			
VÉTEL		ELADÁS	
Mennyiség	Limitár	Limitár	Mennyiség
100	2,50	2,50	100
100	2,00	5,25	100

Z befektetési vállalkozásnak a 100 db július-augusztusi FCAL 2,5 eurón történő eladását tartalmazó naptári különbözeti ügyletre szóló megbízását teljes mennyiségét végrehajtja a rendszer. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	KLMNOPQRST1234567890	Nincs változás
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Ennek az eseménynek az időpontja.
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző		Üresen marad, mert a megbízás teljes mennyisége teljesült, tehát már nem aktív.
15	Sorszám	3759539	Ennek az üzenetnek a sorszáma.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256786	Nincs változás
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX1234567890, XXABCDEFGHJIJ	Nincs változás
20	A megbízás azonosító kódja	Xj26H127c	Nincs változás
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			

21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	FILL	A megbízás maradéktalanul teljesült.
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Limit	Nincs változás
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	Nincs változás
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	2,5	Nincs változás
28	Ügyleti ár	2,5	Végrehajtási ár
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	Nincs változás
33	A megbízás státusza		Üresen marad, mert a megbízás maradéktalanul teljesült.
36	Kezdeti mennyiség	100	Nincs változás
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	0	A fennmaradó mennyiség most 0.
38	Megjelenített mennyiség	0	A látható mennyiség 0, mert a megbízás maradéktalanul teljesült.
39	Kereskedett mennyiség	100	A kereskedett mennyiséget mutatja.
46	Stratégiához kapcsolt megbízás azonosítása		Üresen marad, mert ez a megbízás közvetlenül az naptári különbözeti ügyletek ajánlati könyvébe érkezett.
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	TEKXC456GH20	Kitöltését az indokolja, hogy a végrehajtott ügylet kapjon egyedi ügyletazonosító kódot.

A naptári különbözeti ügyletek ajánlati könyvében szereplő eladási megbízás esetében: A 100 db július-augusztusi FCAL 2,5 eurón történő eladására szóló implikált megbízás teljes mennyiségét végrehajtja a rendszer. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja. Az 1., 2., 3., 4., 5., 6., 7. és 8. mező mindig üresen marad, mert ez egy implikált megbízás, amelyet a kereskedési helyszín és nem egy tagja/részrtvevő hozott létre.

A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok			
N	Mező		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Ennek az eseménynek az időpontja.
E. szakasz – Prioritás és sorszám			

13	Prioritási időbélyegző		Üresen marad, mert a megbízás teljes mennyisége teljesült, tehát már nem aktív.
15	Sorszám	3759540	Ennek az üzenetnek a sorszáma.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256786	Nincs változás
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Nincs változás
20	A megbízás azonosító kódja	Xj26F460g	Nincs változás
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	FILL	A megbízás maradéktalanul teljesült.
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Implikált	Nincs változás
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	Nincs változás
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	2,5	Nincs változás
28	Ügyleti ár	2,5	Végrehajtási ár
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	Nincs változás
33	A megbízás státusza		Üresen marad, mert a megbízás maradéktalanul teljesült.
36	Kezdeti mennyiség	100	Nincs változás
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	0	A fennmaradó mennyiség most 0.
38	Megjelenített mennyiség	0	A látható mennyiség 0, mert a megbízás maradéktalanul teljesült.
39	Kereskedett mennyiség	100	A kereskedett mennyiséget mutatja.
46	Stratégiához kapcsolt megbízás azonosítása	Xj26K983c	Kitöltését a végrehajtás részét képező vonatkozó sima megbízások csatolása indokolja
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	TEKXC456GH20	Kitöltését az indokolja, hogy a végrehajtott ügylet kapjon egyedi ügyletazonosító kódot.

A 225-ös júliusi vételi opció esetében: Részlegesen, 100 db opcióra nézve teljesül X befektetési vállalkozás sima megbízása, amely 200 db júliusi vételi opció vételére szól 225-ös kötési áron és 13 EUR áron. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	12345678901234567890	Nincs változás
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-03-07T10:07:16.523871Z	A sima megbízás bevitelének időpontja
15	Sorszám	3759541	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256718	Nincs változás
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX1234567890	Nincs változás
20	A megbízás azonosító kódja	Xj26F458s	Nincs változás
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	PARF	
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Limit	Nincs változás
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	Nincs változás
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	13	Nincs változás
28	Ügyleti ár	13	Végrehajtási ár
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	Nincs változás
33	A megbízás státusza	ACTI	Nincs változás
36	Kezdeti mennyiség	200	Nincs változás
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	100	.
38	Megjelenített mennyiség	100	
39	Kereskedett mennyiség	100	Az eseményhez kapcsolódó kereskedett mennyiséget mutatja.
46	Stratégiához kapcsolt megbízás azonosítása	Xj26K983c	Kitöltését a végrehajtás részét képező vonatkozó sima megbízásoknak a végrehajtás részét képező implikált

			megbízáshoz való csatolása indokolja
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	TEKXC456GH18	Kitöltését az indokolja, hogy a végrehajtott ügylet kapjon egyedi ügyletazonosító kódot. Ez egy eltérő ügyletazonosító kód, nem az, amelyik a naptári különbözeti ügyletek ajánlati könyvében szerepel.

A 225-ös augusztusi vételi opció esetében: Maradéktalanul teljesül Y befektetési vállalkozás sima megbízása, amely 100 db augusztusi vételi opció vételére szólt 225-ös kötési áron és 15,5 EUR áron. A következő táblázat csak a legfontosabb kitöltendő mezőket, tehát nem az összes kitöltendő mezőt mutatja:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
A. szakasz - A releváns felek azonosítása			
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	ABCDEFGHIJKLMNQRST	Nincs változás
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző		Üresen marad, mert a megbízás teljes mennyisége teljesült, tehát már nem aktív.
15	Sorszám	3759542	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256735	Nincs változás
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XXABCDEFGHIJ	Nincs változás
20	A megbízás azonosító kódja	Xj26F459n	Nincs változás
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	FILL	A megbízás maradéktalanul teljesült.
H. szakasz – Megbízás típusa			
22	A megbízás típusa	Limit	Nincs változás
23	A megbízástípus besorolása	LMTO	Nincs változás
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	15,5	Nincs változás

28	Ügyleti ár	15,5	Végrehajtási ár
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	Nincs változás
33	A megbízás státusza		Üresen marad, mert a megbízás maradéktalanul teljesült.
36	Kezdeti mennyiség	100	Nincs változás
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	0	A fennmaradó mennyiség most 0.
38	Megjelenített mennyiség	0	A látható mennyiség 0, mert a megbízás maradéktalanul teljesült.
39	Kereskedett mennyiség	100	A kereskedett mennyiséget mutatja.
46	Stratégiához kapcsolt megbízás azonosítása	Xj26K983c	Kitöltését a végrehajtás részét képező vonatkozó sima megbízásoknak a végrehajtás részét képező implikált megbízáshoz való csatolása indokolja
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	TEKXC456GH19	Kitöltését az indokolja, hogy a végrehajtott ügylet kapjon egyedi ügyletazonosító kódot. Ez egy eltérő ügyletazonosító kód, nem az, amelyik a naptári különbözeti ügyletek ajánlati könyvében szerepel.

Kiimplikáló funkció

Ugyanaz a módszertan alkalmazandó, mint a beimplikált megbízások esetén.

6.13.8 Prioritás megváltoztatása

Az alábbi eseteket ismertetjük:

- Prioritási időbélyegző az ár-láthatóság-idő a prioritással működő kereskedési rendszerénél;
- Prioritási időbélyegző és prioritási megbízásméret a nagyság-idő prioritással működő kereskedési rendszerénél;
- Prioritási időbélyegző és prioritási megbízásnagyság az arányos párosítással működő kereskedési rendszerénél.

Ár-láthatóság-idő prioritás

137. példa

X befektetési vállalkozás új visszavonásig érvényes vételi megbízást nyújt be 50 db részvényre 10,000 EUR limitáron 2018. június 30-án (UTC szerint) 11:20:30.112121-kor (1. esemény). Egy pillanattal később (UTC szerint) 11:20:31.354454-kor Y befektetési vállalkozás új napi vételi ajánlatot nyújt be 70 db részvényre ugyancsak 10,000 EUR limitáron (2. esemény).

Az ár-idő prioritási szabály miatt a 70 db részvényre szóló megbízás ugyanazon az árszinten, de sorrendben az 50 db részvényre szóló megbízás mögé kerül az ajánlati könyvbe. A különböző prioritásokat a prioritási időbélyegző értékei határozzák meg.

Ha az 50 db részvényre szóló megbízás mennyisége 2018. június 27-én (UTC szerint) 11:20:33.344541-kor 55 részvényre módosul, a megbízás elveszti a 70 részvénnyel szemben meglévő elsőbbségét. Ezért a prioritási időbélyegző mezőben a megbízások ilyen jellegű módosításainak pontos ideje szerepeljen (3. esemény).

Ezen a kereskedési helyszínen a visszavonásig érvényes ajánlat egy évig érvényes.

1. esemény: Új visszavonásig érvényes vételi megbízás bevitele 50 db részvényre

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-06-27T11:20:30.112121Z
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
10	Érvényességi időszak (Validity period)	GTCA
12	Érvényességi időszak dátuma és időpontja	2018-06-27T23:59:59.999999Z
E. szakasz – Prioritás és sorszám		
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T11:20:30.112121Z
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	10,000
28	Ügyleti ár	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
36	Kezdeti mennyiség	50

2. esemény: Új napi vételi megbízás bevitele 70 db részvényre

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-06-27T11:20:31.354454Z
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
10	Érvényességi időszak (Validity period)	DAVY
12	Érvényességi időszak dátuma és időpontja	2018-06-27T23:59:59.999999Z
E. szakasz – Prioritás és sorszám		
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T11:20:31.354454Z
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
20	A megbízás azonosító kódja	45533344ABC
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	NEWO
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	10,000
36	Kezdeti mennyiség	70

3. esemény: 50 részvényre szóló megbízás módosítása

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-06-27T11:20:33.344541Z
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
10	Érvényességi időszak (Validity period)	GTCV
12	Érvényességi időszak dátuma és időpontja	2018-06-27T23:59:59.999999Z
E. szakasz – Prioritás és sorszám		
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T11:20:33.344541Z
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC

G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	REME
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	10,000
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
36	Kezdeti mennyiség	55

Nagyság-idő prioritás

138. példa

X befektetési vállalkozás új vételi megbízást nyújt be 100 db részvényre adott árszinten 2018. június 27-én (UTC szerint) 11:20:30.112121-kor (1. esemény).

Egy pillanattal később (UTC szerint) 11:20:31.354454-kor Y befektetési vállalkozás új vételi megbízást visz be azonos árszinten, de nagyobb mennyiségre (325 db részvényre) (2. esemény). Ezen a kereskedési helyszínen a nagyobb mennyiségű megbízás élvez elsőbbséget a kisebb mennyiségre szólóval szemben.

A nagyság-idő prioritás miatt a 325 db részvényre szóló megbízás az ajánlati könyvben a 100 db darabra szóló megbízás elé kerül. Az illetékes hatóságnak módja van ezt a helyzetet rekonstruálni, ha a kereskedési helyszínen nyilvántartásba vett megbízások esetében külön-külön elsőként a prioritási nagyságot majd pedig azt a prioritási időbélyegzőt veszi figyelembe, amely a prioritási időbélyegző illetve a nagyság prioritás mezőben megjelenik. Ha az 325 db részvényre szóló megbízás mennyisége 2018. június 27-én (UTC szerint) 11:20:35.325891-kor egy módosítás révén 90 részvényre csökken, a megbízás elveszti a 100 részvénnyel szemben meglévő elsőbbségét. A megbízásnak ezt a módosítását a prioritási időbélyegző és a nagyság prioritás mezőben fel kell tüntetni (3. esemény).

A fenti jelenségek esetén mind a prioritási időbélyegző, mind a nagyság prioritás mezőben szerepeljen adat külön-külön minden egyes megbízás és módosítás esetében az alábbiak szerint. Kényelmi okokból a táblázat csak a 13. és a 14. mezőt tartalmazza, hiszen ezek a legfontosabbak a példa szempontjából.

1. esemény: megbízás bevitele 100 db részvényre

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
E. szakasz – Prioritás és sorszám		
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T11:20:30.112121Z
14	Nagyság prioritás	100

2. esemény: megbízás bevitele 325 db részvényre

N		Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13		Prioritási időbélyegző	2018-06-27T11:20:31.354454Z
14		Nagyság prioritás	325

3. esemény: a 325 db részvényre szóló megbízás mennyisége 90 db részvényre módosul

N		Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13		Prioritási időbélyegző	2018-06-27T11:20:35.325891Z
14		Nagyság prioritás	90

Arányos párosítással működő kereskedési rendszer

139. példa

X befektetési vállalkozás 200 db részvényre szóló új vételi megbízást visz be 10,000 EUR limitáron 2018. június 27-én (UTC szerint) 11:20:30.112121-kor egy arányos párosítással működő ajánlati könyvbe, ahol a beérkező megbízás mennyiségét a párosító rendszer a könyvben várakozó megbízások között a fennmaradó mennyiségük arányában osztja szét.

Az arányos megbízaspárosító rendszerrel működő kereskedési helyszínek a 14. mezőben (nagyság prioritás) "0" értéket tüntethetnek fel, amennyiben közzétették a megbízaspárosító rendszer adatait, amelyből az illetékes hatóság képes a megbízások végrehajtásának mechanizmusát rekonstruálni. Ennek megfelelően a 13. és 14. mező kitöltése az alábbiak szerint alakul:

N		Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13		Prioritási időbélyegző	2018-06-27T11:20:30.112121Z
14		Nagyság prioritás	0

6.13.9 Kereskedési fázisok

140. példa

M kereskedési helyszínen egy adott pénzügyi eszköz nyitó aukciós kereskedése 2018. június 27-én (UTC+1 szerint) 07:50:00.425381-kor kezdődik. Ezt megelőzően az ajánlati könyv nem tartalmaz megbízásokat. Megbízások hiányában az indikatív aukciós árfolyam sincs még beállítva, és az indikatív aukciós volumen is 0 részvény (1. esemény). X befektetési vállalkozás (UTC+1 szerint) 07:55:21.528754-kor 100 részvényre szóló vételi megbízást visz be 1 EUR áron (2. esemény).

Y befektetési vállalkozás (UTC+1 szerint) 07:57:46.255897-kor 50 részvény eladására szóló piaci megbízást visz be. Ezzel átfedés jön létre az ajánlati könyvben, és 1 eurón kialakul az indikatív árfolyam, 50 db részvényen pedig az indikatív volumen (3. esemény). Egy vállalkozás (UTC+1 szerint) 07:59:52.264547-kor 25 részvény eladására szóló piaci megbízást visz be. Ez nem befolyásolja az indikatív árfolyamot, de az indikatív volumen 75 részvényre emelkedik (4. esemény). A megbízások között az árfedés az aukció végén (UTC+1 szerint) 08:00:25.149531-kor megszűnik, és a 3. illetve 4. eseményként bevitt két eladási megbízásból valamint a 2. eseményként bevitt vételi megbízásból ügylet jön létre, és ekkor megkezdődik az értékpapír folyamatos kereskedése (5. esemény). A kereskedési fázisok a saját különálló sorokon szerepelnek. A kereskedési fázist tartalmazó sort minden változása esetén kezelni kell. Az indikatív aukciós ár és az indikatív aukciós volumen a saját sorokon együtt láthatók akkor és úgy, amikor és ahogy változnak.

1. esemény: Nyitó aukció

Az 1. sor az alábbi információkat tartalmazza, miközben az összes többi mező (tehát az 50. (indikatív aukciós ár) és az 51. (indikatív aukciós volumen) mező is) üresen marad, mert ezekre a mezőkre a kereskedési fázis változásának bemutatásához nincs szükség. Csak az alábbi mezőket kell kitölteni:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
15	Sorszám	20056	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
16	Szegmensazonosító MIC-kód	XMIC	
17	Az ajánlati könyv kódja	XYZ9876	
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000	
20	A megbízás azonosító kódja		Üresen marad, hiszen a kereskedési fázis változik.
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése,		

	visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása		
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok	Nyílt aukció	

Amikor nyitó aukció megkezdődik, az indikatív aukciós ár mező maradjon üresen, és így jelezze, hogy még nincs kialakult indikatív aukciós ár, és az indikatív aukciós volumen mezőben a 0 részvény értéket is fenn kell tartani. Ezért ennek az információnak meg kell jelennie a 2. sorban, a többi mező pedig üresen marad. Csak az alábbi mezőket kell kitölteni:

A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok			
N	Mező		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
15	Sorszám	20068	
F. szakasz – A megbízási azonosítása			
16	Szegmensazonosító MIC-kód	XMIC	
17	Az ajánlati könyv kódja	XYZ9876	
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000	
20	A megbízási azonosító kódja		Üres, mert csak az indikatív ár és volumen változik.
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
50	Indikatív aukciós ár		Üres, mert még nincs kialakult ár.
51	Indikatív aukciós volumen	0	Nincs aukciós volumen.

2. esemény: Megbízási bevétel 100 db részvényre

Az adatszolgáltatás 3. sora tartalmazza a bevitt új ajánlatot az alábbiak szerint (a táblázatban nem szerepel az összes ajánlatbevételrel kapcsolatos mező):

A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok			
N	Mező		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-06-27T06:55:21.528754Z	

E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T06:55:21.528754Z	
15	Sorszám	20075	
F. szakasz – A megbízás azonosító kódja			
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	NEWO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	1	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
36	Kezdeti mennyiség	100	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	100	
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
50	Indikatív aukciós ár		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
51	Indikatív aukciós volumen		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.

3. esemény: Új megbízás bevitele 50 db részvényre

Az adatszolgáltatás 4. sora tartalmazza a bevitt új ajánlatot az alábbiak szerint (a táblázatban nem szerepel az összes ajánlatbevittel kapcsolatos mező):

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-06-27T06:57:46.255897Z		
E. szakasz – Prioritás és sorszám				
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T06:57:46.255897Z		
15	Sorszám	20089		
F. szakasz – A megbízás azonosítása				
20	A megbízás azonosító kódja	987654321DEF		

G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	NEWO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár		Üresen marad, mert a piaci ajánlat árfolyam nélküli.
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	
36	Kezdeti mennyiség	50	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	50	
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
50	Indikatív aukciós ár		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
51	Indikatív aukciós volumen		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.

Az adatszolgáltatás 5. sora azt mutatja meg, hogyan befolyásolja az indikatív aukciós árat és az indikatív aukciós volument a fenti megbízás bevétele, miközben az összes többi mező üresen marad. Csak az alábbi mezőket kell kitölteni:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-06-27T06:57:46.255897Z	Nincs változás.
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
15	Sorszám	20095	Ennek az eseménynek eltér a sorszáma.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
16	Szegmensazonosító MIC-kód	XMIC	
17	Az ajánlati könyv kódja	XYZ9876	
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000	
20	A megbízás azonosító kódja		Üres, mert csak az indikatív ár és volumen változik.
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
50	Indikatív aukciós ár	1	

51	Indikatív aukciós volumen	50	
----	---------------------------	----	--

4. esemény: Új megbízás bevitelére 25 db részvényre

Az adatszolgáltatás 6. sora tartalmazza a bevitt új ajánlatot az alábbiak szerint (a táblázatban nem szerepel az összes ajánlatbevitellel kapcsolatos mező):

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-06-27T06:59:52.264547Z	A megbízás bevitelének időpontja.
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T06:59:52.264547Z	A bevétel időpontjával azonos.
15	Sorszám	20156	Ennek az eseménynek eltér a sorszáma.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
20	A megbízás azonosító kódja	543216789GHI	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	NEWO	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár		Üresen marad, mert a piaci ajánlat árfolyam nélküli.
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	
36	Kezdeti mennyiség	25	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	25	
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
50	Indikatív aukciós ár		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.

51	Indikatív aukciós volumen		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
----	---------------------------	--	--

Az adatszolgáltatás 7. sora azt mutatja meg, milyen hatást gyakorol mindez az indikatív aukciós árra és az indikatív aukciós volumenre, miközben az összes többi mező üresen marad. Csak az alábbi mezőket kell kitölteni:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-06-27T06:59:52.264547Z		Nincs változás.
E. szakasz – Prioritás és sorszám				
15	Sorszám	20157		Ennek az eseménynek eltér a sorszáma.
F. szakasz – A megbízási azonosítása				
16	Szegmensazonosító MIC-kód	XMIC		
17	Az ajánlati könyv kódja	XYZ9876		
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000		
20	A megbízási azonosító kódja			Üres, mert csak az indikatív ár és volumen változik.
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen				
50	Indikatív aukciós ár	1		Az 1 GBP aukciós ár változatlan marad.
51	Indikatív aukciós volumen	75		A volumen 75 db részvény.

5. esemény: Az aukciós átfedés megszűnik, és megkezdődik a folyamatos kereskedés

Az adatszolgáltatás 8. sora azt mutatja, hogy a 100 db részvényre szóló vételi megbízási az 50 db részvénnyel részlegesen teljesül (a táblázat nem tartalmazza a megbízási vonatkozó összes mezőt):

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-06-27T07:00:25.149531Z		A részleges teljesülés időpontja.
E. szakasz – Prioritás és sorszám				

13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T06:55:21.528754Z	Ugyanaz, mint a bevétel időpontja, mert a megbízás még aktív.
15	Sorszám	20189	Ennek az eseménynek eltér a sorszáma.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	PARF	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár	1	
28	Ügyleti ár	1	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	BUYI	
36	Kezdeti mennyiség	100	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	50	
39	Kereskedett mennyiség	50	
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	ABC123456	
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
50	Indikatív aukciós ár		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
51	Indikatív aukciós volumen		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.

Az adatszolgáltatás 9. sora azt mutatja, ahogy az 50 db részvény eladására szóló megbízás az 50 db részvennyel teljesül (a táblázat nem tartalmazza a megbízásra vonatkozó összes mezőt):

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			

9	Dátum és idő	2018-06-27T07:00:25.149531Z	A teljesülés időpontja.
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző		Üres, mert a megbízás már nem aktív.
15	Sorszám	20190	Ennek az eseménynek eltér a sorszáma.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
20	A megbízás azonosító kódja	987654321DEF	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	FILL	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár		Üresen marad, mert a piaci ajánlat árfolyam nélküli.
28	Ügyleti ár	1	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	
36	Kezdeti mennyiség	50	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	0	
39	Kereskedett mennyiség	50	
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	ABC123456	
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
50	Indikatív aukciós ár		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
51	Indikatív aukciós volumen		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.

Az adatszolgáltatás 10. sora azt mutatja, hogy a 50 db részvényre szóló vételi megbízás az 25 db részvénnyel részlegesen teljesül (a táblázat nem tartalmazza a megbízásra vonatkozó összes mezőt):

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok		Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő				
9	Dátum és idő	2018-06-27T07:00:25.149531Z		A részleges teljesülés időpontja.
E. szakasz – Prioritás és sorszám				
13	Prioritási időbélyegző	2018-06-27T06:55:21.528754Z		A bevétel időpontjával azonos.
15	Sorszám	20256		Ennek az eseménynek eltér a sorszáma.
F. szakasz – A megbízási azonosítása				
20	A megbízási azonosító kódja	123456789ABC		
G. szakasz – A megbízási befolyásoló események				
21	Új megbízási, a megbízási módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	PARF		
I. szakasz – Árak				
24	Limitár	1		
28	Ügyleti ár	1		
J. szakasz – A megbízási vonatkozó instrukciók				
32	Vétel / eladás mutató	BUYI		
36	Kezdeti mennyiség	100		
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	25		
39	Kereskedett mennyiség	25		
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	DEF9876		
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen				
49	Kereskedési fázisok			Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
50	Indikatív aukciós ár			Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
51	Indikatív aukciós volumen			Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.

Az adatszolgáltatás 11. sora azt mutatja, ahogy a 25 db részvény eladására szóló megbízási az 25 db részvennyel teljesül (a táblázat nem tartalmazza a megbízási vonatkozó összes mezőt):

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-06-27T07:00:25.149531Z	A teljesülés időpontja.
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
13	Prioritási időbélyegző		Üres, mert a megbízás teljesült.
15	Sorszám	20257	Ennek az eseménynek eltér a sorszáma.
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
20	A megbízás azonosító kódja	543216789GHI	
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események			
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	FILL	
I. szakasz – Árak			
24	Limitár		Üresen marad, mert a piaci ajánlat árfolyam nélküli.
28	Ügyleti ár	1.	
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
32	Vétel / eladás mutató	SELL	
36	Kezdeti mennyiség	25	
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	0	
39	Kereskedett mennyiség	25	
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	DEF9876	
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
50	Indikatív aukciós ár		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.
51	Indikatív aukciós volumen		Üres marad, mert az eseményhez nem kötelező megadni.

A kereskedés fázis változását a kezelt adatok között a saját sora mutassa be. Ezért az alábbi információnak kell megjelennie a 12. sorban, a többi mező pedig üresen marad. Csak az alábbi mezőket kell kitölteni:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelemszerűen)
C. szakasz – Dátum és idő			
9	Dátum és idő	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Az időbélyegző felbontása 1 mikroszekundum szintig.
E. szakasz – Prioritás és sorszám			
15	Sorszám	20258	Az adott esemény sorszáma a kereskedési helyszínen.
F. szakasz – A megbízási azonosítása			
16	Szegmensazonosító MIC-kód	XMIC	Nincs változás.
17	Az ajánlati könyv kódja	XYZ9876	Nincs változás.
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000	Nincs változás.
20	A megbízási azonosító kódja		Üresen marad, hiszen a kereskedési fázis változik.
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikatív aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok	Folyamatos kereskedés	Megkezdődött a folyamatos kereskedés.

6.14 Jegyzéskérési rendszerek

A jegyzéskérési rendszerben egy vagy több tag vagy résztvevő kérésére egy vagy több jegyzés érkezik. A jegyzést kizárólag az azt kérő tag vagy résztvevő hajthatja végre. A jegyzést kérő tagnak vagy résztvevőnek jogában áll a neki címzett jegyzést vagy jegyzéseket elfogadni. A jegyzés elfogadása bizonyos üzleti partnerek között automatikusan történhet.

A jegyzéskérési rendszernek egyedi jellegzetességei vannak. Az egyesi jellegzetességekkel kapcsolatos adatok kezeléshez meghatározott módon kell a táblázatban található mezőket kitölteni. Ezért a következő példák a jegyzéskérő rendszereknek az alábbi jellegzetességeire vonatkoznak:

- 141. példa Hogyan tartjuk nyilván a konkrét üzleti partnereknek megküldött jegyzéskérését?
- 142. példa Hogyan tartjuk nyilván a jegyzéskérésre korlátozott érvényességi ("távirati") idővel adott választ, amelyet csak az adott jegyzés kérője hajthat végre?
- 143. példa Hogyan tartjuk nyilván a jegyzésre adott választ, ha annak a kéréstől eltérő a mennyisége?
- 144. példa Hogyan tartjuk nyilván a végrehajtást a jegyzéskérési rendszerben?

6.14.1 Hogyan tartjuk nyilván a konkrét üzleti partnereknek megküldött jegyzéskérését?

A jegyzéskérés új megbízásként a megbízási-azonosító kódot valamint a megbízási eseményt (21. mező) feltüntetve tartjuk nyilván. Így benyújtott jegyzéskérésként felismerhető.

Emellett fel kell tüntetni, hogy a jegyzéskérést a kérő az egész piachoz vagy csak konkrét üzleti partnerekhez intézi. Erre a továbbítási stratégiát (47. mező) használjuk. Az üresen hagyott továbbítási stratégia mező azt jelzi, hogy a jegyzéskérést a rendszer a kereskedési helyszín összes tagjának vagy résztvevőjének elküldte. Ellenkező esetben a továbbítási stratégia mezőben egy jogalany-azonosító (LEI) kód áll, amely azt jelzi, hogy a jegyzéskérést az annak megfelelő vállalkozás kapta. Ha a jegyzéskérést egynél több vállalkozás kapta, az egyes címzettek nyilvántartásba vételéhez azonos megbízás-azonosító kód alatt minden egyes vállalkozásra nézve egy példányban ki kell tölteni a mezőket tartalmazó táblázatot (a továbbítási stratégia mezőben feltüntetve a jogalany-azonosító kódot)

141. példa

Egy jegyzésvezérelt kereskedési helyszínen 2018. június 27-én (UTC szerint) 13:05:10-kor X befektetési vállalkozás az XX0000000000 ISIN kódú pénzügyi eszközre vonatkozó eladási szándékát jelzi azzal, hogy egyoldalú ajánlatot kér a mennyiség megjelölésével (1000 db), amely szerint eladja az eszközt a jegyzéskérésre választ adó tagoknak. A jegyzéskérést csak két konkrét tag kapja: Y befektetési vállalkozás (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) és Z befektetési vállalkozás (LEI: KLMNOPQRST1234567890). Hogyan mutassa ezt ki a jegyzésvezérelt kereskedési helyszín a táblázat mezőiben:

Az X befektetési vállalkozás által Y befektetési vállalkozásnak címzett jegyzéskérés:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
A. szakasz - A releváns felek azonosítása		
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	12345678901234567890
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-06-27T13:05:10Z
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
21	Új megbízás, a megbízás módosítása, törlése, visszautasítása, részleges vagy teljes végrehajtása	RFQS ⁴⁹
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	SELL
36	Kezdeti mennyiség	1000
47	Továbbítási stratégia	ABCDEFGHIJKLMNQRST

⁴⁹ Ezt a kódot a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet nem említi, de az {ALPHANUM-4} szabad formátumú mezők közé tartozik. Ilyen konkrét esetekben azonban elvárás a kereskedési helyszínekkel szemben, hogy ezt a konkrét kódot használják.

b) A Z befektetési vállalkozásnak küldött jegyzéskérés (amelynek esetében a táblázat mezőit a fentiekkel egyező módon kell kitölteni (és a megbízás-azonosító kód is azonos lesz), azzal az egyetlen eltéréssel, hogy itt a továbbítási stratégia mezőben Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító kódja fog állni)

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
47	Továbbítási stratégia	KLMNOPQRST1234567890

A jegyzések frissítésére vonatkozó példákat lásd a 6.13.1.2. bekezdésben

6.14.2 Hogyan tartjuk nyilván a jegyzéskérésre korlátozott érvényességi ("vezeték szerinti") idővel adott választ, amelyet az adott jegyzés kérője hajthat végre?

142. példa

Y befektetési vállalkozás 8,750 EUR árat meghatározva 2018. június 27-én (UTC szerint) 13:06:07-kor egyoldalú, (1000 db) XX0000000000 ISIN kódú eszköz vételére szóló, 10 percg érvényes és a jegyzést kérő által végrehajtható piaci ajánlattal válaszol X befektetési vállalkozásnak a fenti 141. példában bemutatott jegyzéskérésére. A jegyzéskérésre adott választ abból lehet felismerni, hogy a megbízási eseményt rögzítő (21.) mezőben az 'RFQR' érték áll. A jegyzést kérő és a jegyzésre válaszoló között a kapcsolat a megbízaskorlátozás mező (11 mező) kitöltésével jön létre, ahol a jegyzésvezérelt kereskedési helyszín a megfelelő jegyzéskérésnél az ajánlat-azonosító kódot szerepelteti (lásd: 141. példa).

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
A. szakasz - A releváns felek azonosítása		
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	ABCDEFGHIJKLMNQRST
C. szakasz – Dátum és idő		
9	Dátum és idő	2018-06-27T13:06:07Z
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
10	Érvényességi időszak (Validity period)	GTSV
11	Megbízaskorlátozás	123456789ABC
12	Érvényességi időszak dátuma és időpontja	2018-06-27T13:16:07Z
F. szakasz – A megbízás azonosítása		

18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000
20	A megbízás azonosító kódja	23456789DEF
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	RFQR ⁵⁰
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	8,750
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	1000

6.14.3 Hogyan tartjuk nyilván a jegyzésre adott választ, ha annak a kéréstől eltérő a mennyisége?

143. példa

Z befektetési vállalkozás 8,750 EUR árat meghatározva egyoldalú, az XX0000000000 ISIN kódú eszköz vételére szóló, a jegyzést kérő X befektetési vállalkozás által végrehajtható piaci ajánlattal válaszol a fenti 141. példában bemutatott jegyzéskérésére, melynek a mennyisége a kért nagysághoz képest eltérő (X befektetési vállalkozás kérése 1000, Z befektetési vállalkozás válasza 600 darabra szólt). A jegyzést kérő és a jegyzésre válaszoló között a kapcsolat a megbízáskorlátozás mező (11 mező) kitöltésével jön létre, ahol a jegyzésvezérelt kereskedési helyszín a megfelelő jegyzéskérésnél az ajánlat-azonosító kódot szerepelteti (lásd: 141. példa).

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
A. szakasz - A releváns felek azonosítása		
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	KLMNOPQRST1234567890
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
11	Megbízáskorlátozás	123456789ABC
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX0000000000

⁵⁰ Ezt a kódot az SZTS nem említi, de az {ALPHANUM-4} szabad formátumú mezők közé tartozik. Ilyen konkrét esetekben azonban elvárás a kereskedési helyszínekkel szemben, hogy ezt a konkrét kódot használják.

20	A megbízás azonosító kódja	78901223GHI
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	RFQR ⁵¹
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMTO
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	8,750
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	600

6.14.4 Hogyan tartjuk nyilván a végrehajtást a jegyzéskérési rendszerben?

144. példa

A jegyzést kérő X befektetési vállalkozás végrehajtja az Y befektetési vállalkozástól a 142. példa szerint kapott árajánlatot. Az ebből létrejött ügyletet két teljesülés jelzi, az egyik az jegyzést kérő X vállalkozásnál, a másik az árajánlattal válaszoló Y vállalkozásnál. A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódját (48. mező) mindkét esetben fel kell tüntetni annak a két jegyzésnek a bemutatására, amelyek az ügyletben részt vesznek. Ezáltal a könyvvizsgálati nyomok teljes sora hozható létre a jegyzéskéréstől, a jegyzésre vonatkozó válaszon át az ügyletig. Az első táblázat X befektetési vállalkozásra nézve mutatja be a jegyzéskérés teljesülését:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
A. szakasz - A releváns felek azonosítása		
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	12345678901234567890
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
11	Megbízaskorlátozás	
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
20	A megbízás azonosító kódja	123456789ABC
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	FILL
I. szakasz – Árak		

⁵¹ Ezt a kódot az SZTS nem említi, de az {ALPHANUM-4} szabad formátumú mezők közé tartozik. Ilyen konkrét esetekben azonban elvárás a kereskedési helyszínekkel szemben, hogy ezt a konkrét kódot használják.

28	Ügyleti ár	8,750
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	SELL
39	Kereskedett mennyiség	1000
47	Továbbítási stratégia	ABCDEFGHIJKLMNQRST
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	GHIJ1234

A második táblázat Y befektetési vállalkozásra nézve mutatja be a jegyzéskérés teljesülését:

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok
A. szakasz - A releváns felek azonosítása		
1	A megbízást továbbító szervezet azonosítása	ABCDEFGHIJKLMNQRST
D. szakasz – Érvényességi időszak és megbízási korlátozások		
11	Megbízaskorlátozás	123456789ABC
F. szakasz – A megbízás azonosítása		
20	A megbízás azonosító kódja	23456789DEF
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	FILL
I. szakasz – Árak		
28	Ügyleti ár	8,750
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
39	Kereskedett mennyiség	1000
47	Továbbítási stratégia	
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	GHIJ1234

7 Iránymutatások az órák összehangolásához

A MiFID II 50. cikke és a kapcsolódó szabályozástechnikai standardok szerint a kereskedési helyszínek valamint ezek tagjai és résztvevői kötelesek betartani az üzleti óráknak az UTC-től való maximális eltérésére vonatkozóan a pontosság követelményét, és kötelesek a jelentendő eseményeket a meghatározott felbontású időbélyegzővel ellátni.

7.1 Jelentendő események

A MiFID II 50. cikkében írtak szerint a kereskedési helyszínek és az azokat kereskedési célokra felhasználó szereplők kötelesek összehangolni a jelentendő események dátumának és idejének rögzítésére alkalmazott üzleti órákat. Az ESMA szerint az 50. cikk értelmezése érdekében fontos a "jelentendő eseményeket" példákon keresztül bemutatni.

Az ESMA szerint a "jelentendő esemény" az alábbi kötelezettségekre terjed ki:

- A kereskedés idejének és a közzététel idejének nyilvánosságra hozatalára az 1 SZTS I. mellékletének 3. táblázata valamint A részvényeknek, a részvényjellegű és a nem-részvény eszközöknek a MiFIR 6., 7., 10. és 11 cikke szerinti átláthatóságáról szóló 2. SZTS II. melléklet 1b) táblázata alapján;
- A kereskedés idejének ügyletjelentésére a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 28. mezőben a MiFIR 26. cikke alapján előírtak szerint;
- A befektetési vállalkozások által végrehajtott megbízásokat és az ügyleteket érintő események idejének nyilvántartására a MiFIR 25. cikk (1) bekezdése szerint, valamint (a telefonbeszélgetések és egyéb elektronikus közlések rögzítésétől eltekintve) a MiFID II 16. cikk (6) bekezdése alapján fennálló, és a 2016. 4. 25-én kelt 2017/565/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletének 74. cikke által előírt nyilvántartási kötelezettségekre (a MiFID II 16. cikk (6) bekezdése szerinti kötelezettségek);
- A 6. SZTS II. melléklete 2. táblázatában, a 27. mezőben és a II. melléklet 3. táblázatában, a 23., 24. és 33. mezőben meghatározott megbízásokat érintő eseményekkel kapcsolatos időpont nyilvántartására, amelyet a nagysebességű algoritmikus kereskedési technikákat alkalmazó befektetési vállalkozások számára a MiFID II 17. cikk (2) bekezdése ír elő.
- A 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet-ben a 9., 12. és 13. mezőben meghatározott megbízásokat érintő eseményekkel kapcsolatos időpont nyilvántartására amelyet a MiFIR 25. cikk (2) bekezdése ír elő.

7.2 Az időbélyegző felbontása

A MiFID II 50 cikke a jelentendő események széles körére vonatkozik (7.1. bekezdés). A 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet két pontossági követelménytípust különböztet meg: az UTC-től való maximális eltérést és az időbélyegző felbonthatóságát. Az iránymutatásoknak ez a szakasza csak az utóbbi követelményre vonatkozik.

Figyelmet érdemel, hogy a MiFID II 50. cikke csak a kereskedési helyszínen végbement jelentendő eseményekre vonatkozik. Nem vonatkozik például az OTC ügyletekre.

Egy kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője nem köteles az időbélyegzőre nézve ugyanazokat a követelményeket teljesíteni, amelyek arra a kereskedési helyszínre érvényesek, amelynek a tagja vagy résztvevője. A tag vagy a résztvevő az időbélyegzőt kizárólag a MiFID II 50. cikke alapján a vállalkozása kereskedési tevékenységére vonatkozó követelmények szerint alkalmazza.

Abban az esetben, amikor egy ügylet végrehajtásában befektetési vállalkozások láncolata vesz részt (s eközben az eredeti megbízást a láncban az egyik befektetési vállalkozás a másiknak továbbítja), akkor a láncban résztvevő egyes befektetési vállalkozások az időbélyegző használatára nézve a saját kereskedési tevékenységükre vonatkozó követelményeknek tesznek eleget függetlenül attól, hogy a láncban résztvevő többi befektetési vállalkozásra milyen időbélyegző követelmények érvényesek.

A MiFIR 26. cikke és a MiFID II 16. cikk (6) bekezdése - Ügyletjelentés, az ügyletek nyilvántartása és a megbízások feldolgozása

7.2.1.1 Kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek

Amikor egy befektetési vállalkozás egy kereskedési helyszínen hajt végre ügyletet (pl. mint a kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője), akkor az ügyletjelentésében a kereskedési dátum és idő mezőben az adatot a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben a kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletekre vonatkozóan meghatározott felbonthatósági szinten tüntesse fel. Ezt az iránymutatások az I. rész 5.4. bekezdésében az "Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen" cím alatt ismerteti. Ehhez hasonlóan a MiFID II 16. cikk (6) bekezdésének hatálya alatt álló befektetési vállalkozások ugyanezt a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben meghatározott követelményt alkalmazzák a kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek és a kereskedési helyszínre benyújtott megbízások időpontjának rögzítésére.

7.2.1.2 Nem kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek

A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. melléklet 2. táblázatában a 28. mezőre vonatkozó követelmények szerint a nem kereskedési helyszínen végrehajtott ügyleteket minden befektetési vállalkozásnak (függetlenül attól, hogy kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője-e) ügyletjelentését másodperc vagy annál pontosabb felbontású időbélyegzővel tanácsos ellátnia. Ehhez hasonlóan a MiFID II 16. cikk (6) bekezdésének hatálya alatt álló befektetési vállalkozások akkor járnak el helyesen, ha a kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek és a kereskedési helyszínre benyújtott megbízások időpontját a legközelebbi másodpercre kerekítve rögzítik.

A nem kereskedési helyszínen végrehajtott (azaz az OTC) ügyletekre nézve a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet leszögezi, hogy az ügyletjelentésben a dátum és az idő egyezzen meg azzal, "amikor a felek bizonyos mezők tartalmában megállapodnak".

7.2.1.3 Példák

Az alábbiakban példákat közlünk arról, hogyan kell a megbízások adatait és az ügyletjelentéseket időbélyegzővel ellátni. Figyelmet érdemel, hogy mivel az időpontok UTC+1 szerintiek, az időbélyegzőt az UTC időhöz kell igazítani. A következő példák abból a feltételezésből indulnak ki, hogy X és Y befektetési vállalkozás a MiFIR 26. cikke alapján ügyletjelentési kötelezettség hatálya alá tartozó befektetési vállalkozás.

145. példa Kereskedési helyszínen végrehajtott megbízások és ügyletek

X befektetési vállalkozás 2018. június 20-án UTC+1 szerint 12:11:38.077312-kor elektronikus üzenetben készpénzes tulajdoni részesedést megtestesítő instrumentumra vonatkozó megbízást kap. Ezt az üzenetet automatikusan feldolgozza, és algoritmusát alkalmazva M kereskedési helyszínen UTC+1 szerint 12:11:38.236931-kor megbízást nyújt be. M kereskedési helyszín a megbízást UTC+1 szerint 12:11:38.478598-kor veszi át (1. megbízás). X befektetési vállalkozás a 2014/65/EU MiFID II irányelv 4. cikk (1) bekezdés 40. albekezdésében meghatározott nagysebességű algoritmikus kereskedési technikát alkalmazta erre a megbízásra.

Y befektetési vállalkozás 2018. június 20-án UTC+1 szerint 13:42:29.327087-kor elektronikus üzenetben készpénzes tulajdoni részesedést megtestesítő instrumentumra vonatkozó megbízást nyújt be. A megbízást M kereskedési helyszín UTC+1 szerint 13:42:29.561123-kor veszi át (2. megbízás). Y befektetési vállalkozás olyan elektronikus rendszert használt, amely nem tartozik 2014/65/EU MiFID II irányelv 4. cikk (1) bekezdés 40. albekezdésében meghatározott körbe.

M kereskedési helyszínen az elektronikus megbízáspárosítási rendszerben az átjárók közötti késleltetés ideje 350 mikroszekundum.

MiFIR 25. cikk és MiFID II 17. cikk – megbízások adatainak nyilvántartása

M kereskedési helyszín akkor jár el helyesen, ha a megbízási eseményt mikroszekundumos vagy annál jobb felbontásban rögzíti, mert az átjárók közötti késleltetési ideje 1 milliszekundumnál rövidebb. Az 1. megbízás esetében a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerinti 9. mezőben a 2018-06-20T11:11:38.478598Z érték álljon, a 2. megbízásnál ugyanebben a mezőben 2018-06-20T12:42:29.561123Z szerepeljen.

X befektetési vállalkozás a megbízási eseményt mikroszekundumos vagy annál jobb felbontásban rögzítse, mert a tevékenységet nagysebességű algoritmikus kereskedési technikával hozta létre (lásd 2. táblázat a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet mellékletében). A megbízás átvételének időpontját jelző időbélyegző a 2018-06-20T11:11:38.077312Z értéket mutassa. A megbízás benyújtásának időpontját jelző időbélyegző értéke pedig 2018-06-20T11:11:38.236931Z legyen.

Y befektetési vállalkozás a megbízási eseményt milliszekundumos vagy annál jobb felbontásban rögzítse, mert a tevékenység 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet mellékletének 2. táblázatában az utolsó sorba tartozó elektronikus kereskedés révén jött létre. Az időbélyegző értéke 2018-06-20T12:42:29.327Z legyen.

MiFIR 26. cikk - ügyletjelentés

Ha X és Y befektetési vállalkozás megbízásait M kereskedési helyszín hajtaná végre, akkor mind X, mind Y vállalkozásnak ügyletjelentési kötelezettsége keletkezne.

X befektetési vállalkozásnak a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerinti 28. mezőt kellene kitöltenie (kereskedési dátum és időpont) mikroszekundumos vagy annál jobb felbontásban a piaci végrehajtást bemutató ügyletjelentésben. Y befektetési vállalkozásnak a piaci végrehajtást mutató ügyletjelentésben milliszekundumos vagy annál jobb felbontást helyes alkalmaznia.

146. példa Nem kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek

A 145. példa folytatása: Abból a feltételezésből kiindulva, hogy X befektetési vállalkozás a készpénzes tulajdoni részesedést megtestesítő instrumentumot A kereskedési helyszínen szerezte meg, X

befektetési vállalkozásnak ügyletjelentési kötelezettsége keletkezik, ha az instrumentumot ezt követően eladta az ügyfelének. A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet mellékletében a 2. táblázatban szereplő 28. Mező "kereskedési dátum és idő" meghatározása szerint X befektetési vállalkozásnak ügyletjelentésében ide másodperces vagy annál jobb felbontásban kell adatot kitöltenie.

147. példa Kereskedési helyszínen végrehajtott megbízások és ügyletek

X befektetési vállalkozás A kereskedési helyszínen 2018. június 20-án (UTC+1 szerint) 15:01:25.369310-kor globális letéti igazolásra nyújt be megbízást, amelyet A kereskedési helyszínen 15:01:25.458482-kor vesz át.

Ebben az esetben A kereskedési helyszínen a 116. példában megadotthoz képest eltérő elektronikus megbízáspárosító rendszert használ. Ennek a rendszernek az átjárók közötti késleltetési ideje 1,2 milliszekundum.

X befektetési vállalkozás az ajánlat benyújtására olyan elektronikus rendszert használt, amely nem tartozik a MiFID II 4. cikk (1) bekezdés 40. albekezdésében meghatározott körbe.

MiFIR 25. cikk és MiFID II 17. cikk – megbízások adatainak nyilvántartása

Az A kereskedési helyszínen akkor jár el helyesen, ha a megbízási eseményt milliszekundumos vagy annál jobb felbontásban rögzíti, mert az átjárók közötti késleltetési ideje 1 milliszekundumnál hosszabb. A 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerinti 9. mezőbe a 2018-06-20T14:01:25.458Z érték kerüljön.

X befektetési vállalkozás a megbízási eseményt milliszekundumos vagy annál jobb felbontásban rögzítse, mert a tevékenység 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet mellékletének 2. táblázatában az utolsó sorba tartozó elektronikus kereskedés révén jött létre. Az időbélyegző értéke 2018-06-20T14:01:25.369Z legyen.

MiFIR 26. cikk - ügyletjelentés

Ha X befektetési vállalkozás megbízásának végrehajtására A kereskedési helyszínen került sor, X befektetési vállalkozásnak a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerinti 28. mezőt kellene kitöltenie (kereskedési dátum és időpont) milliszekundumos vagy annál jobb felbontásban a piaci végrehajtást bemutató ügyletjelentésben.

Olyan lánc esetében, ahol a végső ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen történik, kizárólag a kereskedési helyszínen közvetlen piaci jelentését kell a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 3. cikke szerinti felbontásban elkészíteni, a többi jelentésben elég az adatszolgáltatást másodperces vagy annál jobb felbontásban szerepeltetni. A más vállalkozásoknál megbízást elhelyező befektetési vállalkozások a végrehajtó vállalkozástól hang- vagy elektronikus üzenetben megkapott végrehajtási időpontot állíthatják be a jelentésükbe.

7.3 A maximális megengedett eltérés mértékére vonatkozó követelmények teljesítése

A 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet két pontossági követelménytípust különböztet meg: az UTC-től való maximális eltérést és az időbélyegző felbonthatóságát. Az

iránymutatásoknak ez a szakasza csak az előbbi követelményre vonatkozik. A 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikke leszögezi, hogy a "kereskedési helyszínek működtetői, valamint tagjai vagy résztvevői kidolgoznak egy rendszert az UTC-re való visszavezethetőség biztosítására". Ennek részeként gondoskodnak arról, hogy rendszereik a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben előírtak szerinti felbonthatóságnak és az UTC-től való maximális megengedett eltérésnek megfelelően működjenek. Emellett a kereskedési helyszínek működtetői, tagjai és résztvevői igazolják, hogy a rendszerben használt alapvető elemek a felbonthatóság és az UTC-től való maximális megengedett eltérés szempontjából a rendszer gyártója által garantált és meghatározott pontossági szabvány szintjeinek megfelelnek (az elemek specifikációja teljesíti a megkövetelt pontossági szinteket), és ezek a rendszerelemeknek a rendszerbe állítása a gyártó telepítési útmutatójának megfelelően történt.

Követelmény a rendszer releváns és arányos tesztelése illetve releváns és arányos monitoringja annak érdekében, hogy az UTC-től való eltérés a tűrési határon belül maradjon. A relevancia és az arányosság az UTC-től való maximális megengedett eltérés aktuális mértékétől függ.

A 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 1. cikke alapján a jelentendő események bejelentésére elfogadhatónak tekinthetők az olyan rendszerek, amelyek a Nemzetközi Mérésügyi Irodának az időméréshez kapcsolódó tevékenységekről szóló éves jelentésében felsorolt időzóna-központok által kibocsátott és fenntartott egyeztetett világidőre (UTC) közvetlenül visszavezethetők. A USA globális helymeghatározó rendszeréhez (GPS) vagy bármely egyéb globális navigációt segítő műholdas rendszerhez, például az orosz GLONASS vagy az üzembe lépése után az európai Galileo műholdas rendszerhez tartozó időforrásnak a használata a jelentendő események adatszolgáltatására az UTC-től való eltolás számításba vétele és az időbélyegzőből való eltávolítása mellett szintén elfogadható. A GPS idő eltér az UTC szerinti időtől. Ugyanakkor a GPS időüzenet az UTC-hez képest (szökőmásodpercek formájában) egy eltolást is tartalmaz, amelyet a GPS időbélyegzővel összevonva kapjuk meg a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben előírt maximális megengedett eltérésnek megfelelő időbélyegzőt. Az ilyen rendszerek használóinak ismernie kell a használattal járó releváns kockázatokat, például a napkitöréseket, az interferenciát, a zavarást illetve a többutas visszaverődést, és tudnia kell, hogy a vevő helyesen csatlakozik-e a jelre. Ezért megfelelő intézkedésekkel ezeket a kockázatokat tanácsos a minimumra csökkenteni. Azok a szervezetek, amelyek GPS vevőt terveznek használni, vegyék figyelembe különösen a Nemzetközi Távközlési Egyesület TF.1876-os rádiókommunikációs (ITU-R) ajánlását azokról a megbízható időforrásokról⁵², amelyekre szigorúbb pontossági követelmények vonatkoznak.

A 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkének értelmezésében a műholdas rendszert használókra az SZTS szerint érvényes pontossági követelmény a tartományrendszer határán belül bármely olyan pontra értendő, ahol az időt mérik. Ugyanakkor a műholdról érkező időbélyegző üzenet fogadására használt vevőkészülék (és az esetleg hozzá tartozó antenna) az első olyan pont, ahol a rendszer terveit, működését és specifikációit tanácsos figyelembe venni (pl. a GPS vevőkészülék modelljét és annak mértékadó pontosságát). Ebbe nem tanácsos belefoglalni a GPS műholdas rendszert és azt sem, hogy a műholdak visszavezethetők-e az UTC-re.

7.3.1 Szökőmásodpercek

Amikor a Nemzetközi Földforgás és Referencia-rendszer Szolgálat (IERS) időszakos bejelentései alapján az UTC időhöz egy-egy szökőmásodpercet hozzá kell adni, vagy belőle ki kell vonni, akkor ezt

⁵² A TF.1876-os (04/2010) ajánlás ezen a címen érhető el: <https://www.itu.int/rec/R-REC-TF.1876-0-201004-I/en>

a Nemzetközi Távközlési Egyesület TF. 460-6-os rádiókommunikációs (ITU-R) ajánlásával összhangban tanácsos megtenni. Az ajánlás leszögezi, hogy a pozitív szökőmásodperc 23:59:60-kor kezdődik és 00:00:00-kor ér véget, míg a negatív szökőmásodperc kifejezésére az idő 23:59:58-ról 00:00:00-ra áll.

7.3.2 A helyi idő és az eltolódás az UTC-hez képest

Az időbélyegzést helyi idő szerint is fenn lehet tartani, de az illetékes hatósághoz már UTC (zulu) időre (nullás időzónára) átalakítva kell eljuttatni az adatokat. Egyes időbélyegző üzenetek magát az időbélyegzőt és az adott időbélyegzőnek az UTC-től való eltérését is tartalmazzák. Itt ismét az a szabály, hogy az illetékes hatóságnak bejelentett időbélyegzőnek már tartalmaznia kell az eltérést, tehát az illetékes hatóság csak egyetlen időbélyegzőt kapjon.

7.3.3 A kereskedési helyszínen közvetlen tagsággal vagy részvétellel nem rendelkező befektetési vállalkozásokra vonatkozó joghatály

A MiFID II 50. cikkének hatálya kizárólag a kereskedési helyszínekre és azok tagjaira, résztvevőire terjed ki. A MiFIR-re vonatkozó 6. SZTS és a MiFID II 16. cikk (6) bekezdésének követelményei a befektetési vállalkozásokra a kereskedési helyszínen fennálló tagságtól vagy részvételtől függetlenül kiterjednek. E két rendelet hivatkozik a maximális megengedett eltérés követelményeire, és ezt úgy érdemes értelmezni, hogy azok a befektetési vállalkozásokra csak akkor terjednek ki, ha valamelyik kereskedési helyszín tagjaként vagy résztvevőjeként járnak el, mert ez áll összhangban az első szintű szövegben meghatározott kötelezettség terjedelmével.

7.4 Alkalmazások, gazda és vezetékes rendszerek időbélyegzői

Az alkalmazások és a gazda rendszerek időbélyegzői a szoftver alkalmazáson belül készülnek, míg a vezetékes időbélyegzőket külön hardver hozza létre, amely eközben a releváns információt tartalmazó hálózati csomagok egy példányát is felveszi. Az ESMA szerint ezek közül az időbélyegzők közül a tagok és a résztvevők bármelyiket használhatják. A kereskedési helyszínek jó, ha tekintetbe veszik azonban, hogy mivel az események rögzítésének követelménye a megbízás párosító rendszerre értendő, ezért nagy valószínűséggel az alkalmazás által létrehozott időbélyegzőt fogják használni.

7.5 Az átjárók közötti késleltetés

A kereskedési helyszínek a különböző percentilisekhez több átjárók közötti késleltetési időt is felsorolhatnak. Az ESMA szerint az órák összehangolása szempontjából a kereskedési helyszínek akkor járnak el helyesen, ha a 99. percentilisére vonatkozó átjárók közötti késleltetési időt használják.

A kereskedési helyszín a 13. cikk c) pontja alapján köteles az átjárók közötti késleltetés időtartamát valós időben figyelemmel kísérni (ESMA/2015/1464)⁵³. Ha az átjárók közötti késleltetés időtartama 1 milliszekundumnál hosszabb időről azzal egyenlő vagy annál rövidebb időtartamra javul, akkor megváltoznak a kereskedési helyszínek az 50. cikk alapján fennálló időfelbontásra és maximális

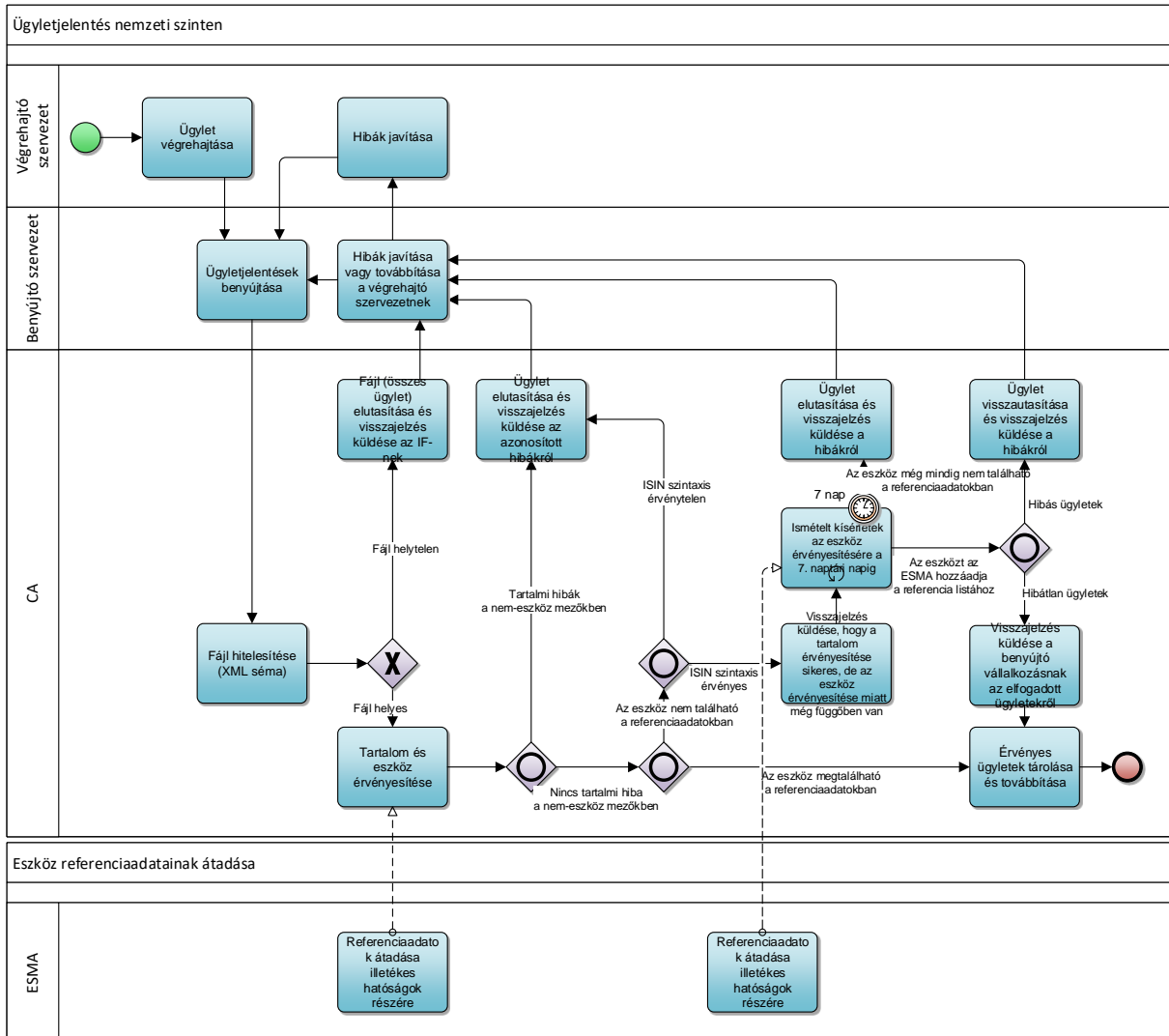
⁵³ A BIZOTTSÁG 2016. 07. 14-i (EU) 2017/584/EU FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek a kereskedési helyszínekre vonatkozó szervezeti követelményeket meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

megengedett eltérésre vonatkozó kötelezettségei. Ilyen forgatókönyv kialakulása egy új megbízaspárosító rendszerre történő átállás illetve a helyszíni létező infrastruktúrájának technológiai javítása után a legvalószínűbb, ezért az ilyen munkák tervezésénél érdemes az időbélyegzőre vonatkozó követelményeket megfontolni.

8 Mellékletek

I. sz. melléklet: A benyújtó szervezetektől beérkező jelentések feldolgozása

A következő ábra az ügyletjelentés nemzeti szintű folyamatát mutatja be:



A következő táblázat a folyamat főbb eseményeire érvényes határidőket foglalja össze:

Jelölés	Feladat	Határidő
T	Ügylet végrehajtása	
R	A jelentő szervezet benyújtja az ügyletjelentéseket	T+1 munkanap
	Visszajelzés a jelentő szervezetek részére	R+1 naptári nap (referenciaadatot nélkülöző)

		eszköz esetében R+7 naptári nap)
--	--	----------------------------------

A T napon végrehajtott ügylet bejelentése legkésőbb a következő munkanap zárásáig, azaz T+1 napon megtörténik.

Az egyes illetékes hatóságok a jelentések benyújtására vonatkozóan belátásuk szerint előírhatnak műszaki eljárásokat és menetrendeket.

Az illetékes hatóságok a beérkező jelentéseket a következő napon érvényesítik:

A fájl érvényesítése – annak igazolása, hogy a fájl (az egész fájl és az adott ügyletjelentések szintaxisa) megfelel az XML sémának. Ha a fájl nem megfelelő, az illetékes hatóság az egész fájlt (a benne található összes ügylettel együtt) visszautasítja.

A tartalom érvényesítése – igazoló szabályok halmaza fut le minden egyes ügyletjelentésre vonatkozóan, és igazolja a konkrét mezők tartalmának helyességét. A helytelen ügyletjelentéseket visszautasítja, a helyeseket pedig további lépésekben feldolgozza. Ezek az érvényesítési szabályok az eszköz referenciaadataitól függenek.

A fájlok érvényesítését mindegyik hatóságnak el kell végeznie. Ezek az érvényesítési szabályok ellenőrzik az XML fájl szintaxisának helyességét.

A fájlok sikeres érvényesítése után a fájlban foglalt minden egyes ügyletre nézve végre kell hajtani a tartalomérvényesítés szabályait. E szabályok közé tartozik különösen annak igazolása, hogy a referenciaadatokban szerepel-e az az eszköz vagy (egyresen tőzsdén kívül vagy az EU-n kívüli szervezett kereskedési platformon származtatott termékben kötött ügyletek esetében) az az alapul szolgáló pénzügyi eszköz, amelyre az ügyletet végrehajtották, és a bejelentett ISIN kód a szintaxis/ellenőrző szám szempontjából helyes-e. A következő eseteket lehet megvizsgálni:

Ha az ügyletjelentés helyes (minden szabály teljesül) és a bejelentett eszköz szerepel a referenciaadatokban → az ügyletjelentést az illetékes hatóság elfogadja;

ha az eszközt/alapterméket kivéve a mezőkkel kapcsolatos tartalmi hiba nincs, de a bejelentett eszköz a referenciaadatok közül hiányzik, és a bejelentett ISIN kód szintaxisa / ellenőrző száma is helyes → a következő lépéseket indokolt megtenni:

az illetékes hatóság tájékoztassa a benyújtó vállalkozást, hogy az ügylet az eszköz érvényesítése alatt függőben van;

miután a jelentés a benyújtó vállalkozástól beérkezik, az illetékes hatóság a beérkezéstől számított 7. naptári napig minden nap folytassa le az eszközigazolást;

ha az eszköz 7 naptári napon belül megjelenik a referenciaadatok között, és az eszköz igazolása miatt nem keletkezik tartalmi hiba, az ügyletjelentést az illetékes hatóság elfogadja;

ha az eszköz 7 naptári napon belül megjelenik a referenciaadatok között, viszont az eszköz igazolása miatt tartalmi hiba keletkezik, az ügyletjelentést az illetékes hatóság elutasítja;

ha 7 naptári nap elteltével az eszköz még mindig nem jelenik meg a referenciaadatokban, az illetékes hatóság az ügyletjelentést elutasítja, és ennek megfelelő üzenetet küld a benyújtó vállalkozásnak;

ha az eszközt/alapterméket kivéve a mezőkkel kapcsolatos tartalmi hiba nincs, de a bejelentett eszköz a referenciaadatok közül hiányzik, viszont a bejelentett ISIN kód szintaxisa / ellenőrző száma helytelen → az ügyletjelentést az illetékes hatóság azonnal elutasítja;

ha eszközt/alapterméket kivéve egyéb mezőkkel kapcsolatosan is van tartalmi hiba → az ügyletjelentést az illetékes hatóság azonnal elutasítja, tehát nem vár további 7 napig. Az azonosított hibákról visszajelzést kell adni.

A tartalom igazolását csak azokra a fájlokra nézve hajtja az illetékes hatóság végre, amelyek esetében a fájl szintű érvényesítés sikerrel járt. Tanácsos minden egyes érvényesítési szabályt lefolytatni a fájlban található összes ügyletre nézve.

Ha valamelyik ügyletjelentés egy vagy több érvényesítési szabálynak nem felel meg, az illetékes hatóság utasítsa el azt. Az érvényesítési szabályoknak megfelelő jelentéseket a hatóság fogadja el. Előfordulhat, hogy az illetékes hatóság a fájlban foglalt ügyletjelentések közül néhányat elfogad, néhányat pedig elutasít. A MiFIR 26. cikk (7) bekezdésének utolsó albekezdése fényében a benyújtó szervezet akkor jár el helyesen, ha az elutasítás után azonnal intézkedik a hibák indokolatlan késedelem nélküli javításáról. A T napon végrehajtott ügyletek érvényesítésére az illetékes hatóságok a T naptól rendelkezésre álló referenciaadatokat használják. Az ügyletek vagy a referenciaadatok késedelmes bejelentésével kapcsolatos ügyek kezelése érdekében a T+1 nap elteltével érvényesített vagy továbbított ügyleteknél az illetékes hatóság az érvényesítés lefolytatásának napján elérhető legfrissebb referenciaadatokat használja, ha például a T napon végrehajtott ügyletről a befektetési vállalkozástól T+10 napon érkezik meg a bejelentés, akkor ezt az ügyletet az érvényesítés napján rendelkezésre álló legfrissebb referenciaadatok alapján tanácsos érvényesíteni.

A visszajelzést tartalmazó fájlokat legkésőbb a jelentés benyújtását követő napon (azaz R+1 napon, ahol R a jelentés napja) helyes elkészíteni és kiküldeni. A visszajelzés tartalmazza az ügyletjelentés helyes benyújtásának visszaigazolását valamint hibaüzeneteket amennyiben a benyújtott ügyletjelentések vagy teljes fájlok hibásak. Ha az illetékes hatóság valamelyik ügyletjelentést elutasítja, a visszajelzéseként küldött üzenet jelezze konkrétan a lefolytatott érvényesítési szabályt és a hiba jellegét.