

A Magyar Nemzeti Bank 1/2019. (I.30.) számú ajánlása

az ügyletek jelentéséről, a megbízások nyilvántartásáról és az órák összehangolásáról

I. Az ajánlás célja és hatálya

Az ajánlás célja, hogy a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (Kbftv.) szerinti befektetési alapkezelők kivételével a befektetési vállalkozások¹(a továbbiakban: befektetési vállalkozás), kereskedési helyszínek², jóváhagyott jelentési mechanizmusok³ és rendszeres internalizálók⁴ számára útmutatást adjon a pénzügyi eszközök piacairól és a 648/2012/EU rendelet módosításáról szóló 2014. május 15-i 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet (a továbbiakban: **MiFIR**), valamint a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet⁵, a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet⁶ és a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet⁷ ügyletjelentésre és megbízások nyilvántartására vonatkozó rendelkezéseinek betartásához. Az ajánlás ezen követelmények következetes alkalmazásáról kíván gondoskodni. Az ajánlás elsősorban az ügyletek jelentésekor, valamint a megbízások nyilvántartásában a lehetséges forgatókönyvek esetében alkalmazandó adatmezők tartalmára és a jelentések formátumára koncentrál. Az ajánlás nem tartalmazza a lehetséges forgatókönyvek kimerítő listáját, ezért az ajánlás hatálya alá tartozó személyek akkor járnak el helyesen, ha a nyilvántartásaik és jelentéseik létrehozásához a leginkább releváns forgatókönyv elemeit használják. Az ajánlásban foglalt elvárások követése az MNB által felügyelt befektetési vállalkozások és kereskedési helyszínek alapvető érdekeit szolgálja.

A befektetési vállalkozások és kereskedési helyszínek működésére vonatkozó MiFIR és a pénzügyi eszközök piacairól, valamint a 2002/92/EK irányelv és a 2011/61/EU irányelv módosításáról szóló 2014. május 15-i 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelv (a továbbiakban: **MiFID II**) részletesen meghatározza az ügyletjelentési és nyilvántartási kötelezettségekre vonatkozó szabályokat és alapelveket. Az uniós normáknak való megfelelést a magyar szabályozás a MiFID II vonatkozó rendelkezéseinek a tőkepiacról szóló 2001. évi CXX. törvény (a továbbiakban: **Tpt.**), valamint a befektetési vállalkozásokról és az árutőzsdei szolgáltatókról, valamint az általuk végezhető tevékenységek szabályairól szóló 2007. évi CXXXVIII. törvény (a továbbiakban: **Bszt.**) rendelkezései közé való beemelésével biztosítja.

Az ajánlásban meghatározott fogalmak kizárólag a MiFIR megbízási adatok nyilvántartási

¹ A jelen ajánlás tekintetében tehát a Bszt. 4. § 10. pontjában szereplő fogalom meghatározás szerint, ide nem értve a kollektív befektetési formákról és kezelőikről szóló 2014. évi XVI. törvény (Kbftv.) szerinti befektetési alapkezelőket

² A Bszt. 4. § 34a. pontjában szereplő fogalom meghatározás szerint.

³ A Bszt. 4. § 1d. pontjában szereplő fogalom meghatározás szerint.

⁴ A Bszt. 4. § 56. pontjában szereplő fogalom meghatározás szerint.

⁵ A Bizottság (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. július 28.) a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az ügyletek illetékes hatóságoknak történő bejelentésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (HL L 87., 2017.3.31., 449–478. o.).

⁶ A Bizottság (EU) 2017/580 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. június 24.) a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a pénzügyi eszközökre vonatkozó megbízások lényeges adatainak megőrzésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (HL L 87., 2017.3.31., 193–211. o.).

⁷ A Bizottság (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. június 7.) a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelvnek az üzleti órák összehangolásának mértékét meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (HL L 87., 2017.3.31., 148–151. o.).

kötelezettségeiről szóló 25. cikkére és az ügyletjelentési kötelezettségről szóló 26. cikkére, valamint a a Bszt. 152. § (2) bekezdésére, a 154/G. § (3) bekezdésére, valamint a Tpt. 316/C. §-ára vonatkoznak.

Az ügyletjelentés, a megbízások nyilvántartása és az órák összehangolása kapcsán az Európai Értékpapír-piaci Hatóság (a továbbiakban: **EÉPH**) 2017. augusztus 10-én iránymutatást⁸ adott ki (a továbbiakban: **EÉPH iránymutatás**). Az MNB az EÉPH iránymutatásban megfogalmazott elvárásokat alapul véve jelen ajánlásban határozza meg az ügyletjelentéssel, a megbízások nyilvántartásával és az órák összehangolásával szemben megfogalmazott elvárásait. Az MNB jelen ajánlás közzétételével biztosítja az EÉPH iránymutatásban foglaltaknak való megfelelést.

Az ajánlás címzettjei a befektetési vállalkozások, kereskedési helyszínek és jóváhagyott jelentési mechanizmusok.

Az ajánlás tárgyi hatálya a MiFIR 26. cikkében foglalt ügyletjelentések benyújtására; a megbízásoknak a MiFIR 25. cikke szerinti nyilvántartására és az üzleti óráknak a a Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a szerinti összehangolására terjed ki.

II. Értelmező rendelkezések

1. A MiFIR rendelet, valamint a Bszt. és a Tpt. által használt fogalmak az ajánlásban szereplő fogalmakkal azonos jelentéssel bírnak. Emellett amikor az ajánlás a "vállalkozás" kifejezést használja, ellenkező rendelkezés hiányában olyan vállalkozást jelent, amely nem a Bszt. szerinti befektetési vállalkozás. Továbbá amikor az ajánlás adott "mezőre" hivatkozik, azon a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletének 2. táblázatában, illetve, a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet mellékletének 2. táblázatában szereplő mezőt kell érteni.

III. Az ügyletjelentésre vonatkozó ajánlások

2. Az ajánlás ügyletjelentésre vonatkozó fejezete négy fejezetből áll:
 - **I. fejezet – Általános elvek.** Az ajánlás ismerteti az ügyletjelentésre vonatkozó általános elveket, továbbá tárgyalja az ügyletjelentés során beküldendő riport létrehozásának és beküldésének módját, valamint a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (5) bekezdésében meghatározott ügylet jelentésére nézve további útmutatást ad az ügyletjelentés hatálya alóli egyes kizárásokról.
 - **II. fejezet – Blokkok.** Ez a fejezet 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.

⁸ https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1452_guidelines_mifid_ii_transaction_reporting.pdf

- **III. fejezet – Forgatókönyvek.** Az ajánlás az ügyletjelentés során előforduló lehetséges kereskedési forgatókönyvek alapján példákat mutat be, melyek ismertetik a megbízások továbbításából, csoportosított megbízásokból és a közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA) biztosításából származó ügyletekre vonatkozó jelentéstételt.
 - **IV. fejezet – Pénzügyi eszközök.** Az ajánlás ezen fejezete a pénzügyi eszközökre⁹ vonatkozó ügyletjelentéshez nyújt útmutatást. Az ismertetett példák elsősorban a származtatott termékekre koncentrálnak, tekintve, hogy ezeknél a pénzügyi eszközöknél az ügyletjelentés szerkezete összetettebb.
3. Az ajánlásban ismertetett példák mellett megtalálható az ügyletjelentés során releváns mezők tartalmát, valamint az adatok XML szerinti szöveges megjelenítését bemutató táblázat. Eltérő elvárás hiányában a táblázatok és XML szövegek az alábbiak szerint értelmezendők:
- Az "N", illetve "Mező" oszlop a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletének 2. táblázatában található mezők számát, illetve nevét jelöli.
 - Az "Érték" oszlop a példa értékét jelöli. Az értékek egyszeres idézőjelek között állnak. Egyes esetekben a példák leíró értékeket használnak (például "X vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja"), melyek helyére a leírásnak megfelelő aktuális értéknek, azaz a konkrét LEI kódznak kell kerülnie. Az XML szövegben a jelmagyarázatban található fiktív tételek értékei alkalmazandóak. A zárójeles kifejezések (például {LEI}) a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. mellékletének 1. táblázatában ismertetett adattípusokra utalnak.
 - Az "Érték" oszlop üresen hagyott cellái azt jelölik, hogy az adott érték a példával szemléltetett forgatókönyvre nem vonatkozik, ezért a mező üres hagyandó.
4. Az ajánlásban szereplő XML szövegek az MNB-hez benyújtandó ügyletjelentésben szereplő adatok megjelenését mutatják be. Ugyanakkor az ISO 20022 formátum megfelelő teljesítése érdekében elvárt a formátumra vonatkozó teljes műszaki leírást tanulmányozni, és csak a teljes műszaki leírás tekinthető a formátum helyes specifikációjának¹⁰.
5. A MiFIR 26. cikk (2) bekezdése alapján a példákban hivatkozott összes eszköz jelentendő pénzügyi eszköznek minősül.

⁹ A Bszt. 6. §-ában szereplő fogalom meghatározás szerint.

¹⁰ https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf

6. Az ajánlásban ismertetett példák csak a vizsgált felekre mutatják be az ügyletjelentés módját, mely azonban nem jelenti azt, hogy a példában szereplő egyéb feleknek nincs ügyletjelentési kötelezettségük.
7. Eltérő elvárás hiányában minden időpont UTC idő szerint értendő. Ugyan a dátum és az idő a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. melléklet 2. táblázat 28. mezője által előírt minimális felbonthatóság szerint jelenik meg, az ajánlás 63. pontja alapján azonban nagyobb felbontásban is jelenthető.
8. Az alapfeltételezés szerint minden kereskedés elektronikus kereskedésnek minősül, a jelentendő idő felbontása szempontjából azonban nem tekintendő nagysebességű algoritmikus kereskedési technikának. Kifejezett jelzés hiányában a példákban jelentésekkel bemutatott befektetési vállalkozások "egyéb szerepben" járnak el.

9. Jelmagyarázat:

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'). A kereskedési helyszín anonim ajánlati könyvet működtet a 11111111111111111111 LEI számú központi szerződő féllel.

1. ügyfél: természetes személy, Jean Cocteau, francia állampolgár, születési ideje: 1962. június 4. (összeűzött 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.

10. Az ajánlás a példákban szemléltetett lényeges elemek kiemelése érdekében a táblázatokban és XML szövegekben a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerinti kötelező mezők közül csak egy részhalmazt ismertet. Az adott példában konkrétan nem említett mezők azonban az ügyletjelentés szempontjából relevánsak lehetnek, melyeket megfelelően szükséges jelenteni.

11. A ügyletjelentések megfelelő teljesítése érdekében jelen ajánlást a MiFIR rendelet, a MiFID II, valamint a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet, a 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet és a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet vonatkozó rendelkezéseivel együtt kell értelmezni. Amennyiben az EÉPH és az MNB további ügyletjelentésre vonatkozó technikai leírást ad ki, a jelen ajánlás mellett az abban foglaltakat is alkalmazni kell.

III.1. I. fejezet – Általános elvek

12. Az ügyletjelentés általános megközelítésben

- a) Az ügyletjelentés az ügyletről olyan ismertetést kíván nyújtani, amely informálja az MNB-t mindazon releváns körülményekről, amelyek között az ügylet létrejött. Egy-egy ügyletről akár több jelentésben is be kell számolni annak függvényében, hogy mi a befektetési vállalkozás kereskedési szerepe, és hogy ügyfél nevében kereskedik-e.
- b) A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 32. preambulumbekzdésében jelzett feladatainak teljesítéséhez az MNB-nek a MiFIR 26. cikkében rögzített ügyletjelentési kötelezettség hatálya alá tartozó ügyletekről pontos és átfogó ismeretekre van szüksége. 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 ajánlott gondoskodnia arról, hogy az ügyletjelentés az általa, mint végrehajtó jogalany által, az adott pénzügyi eszközökben lebonyolított jelentendő ügyletek¹¹ 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 pénzügyi eszközöket, majd ezeket azonos mennyiségben eladja az ügyfelének, a befektetési vállalkozásnak ajánlott a jelentésében jeleznie, 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 a jelentéseket vagy a jelentések bármelyikét. 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 ajánlás alapján ne nyújtson be külön ügyletjelentést az adott ügyletről se saját kitettség nélküli ügyletpárosító szerepében se "egyéb szerepben", mert azzal mesterségesen növeli a saját végrehajtású bejelentett ügyleteinek a számát. Továbbá a befektetési vállalkozásnak javasolt egy adott ügyletre vonatkozó egyedi jelentéseit egymással összhangban jelenteni, melyek pontosan tükrözik a befektetési vállalkozás, az üzleti partnerei és ügyfelei, valamint a megbízás alapján az ügyfelek nevében eljáró felek szerepét.
- c) 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 MNB-nek. 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

¹¹ 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.

megfelelő vonatkozó jelentéseiben a köztük létrejött ügylet közös tárgyi elemeit ismertető alábbi mezőknek tartalom szempontjából egyezniük kell: helyszín¹², kereskedés dátuma és időpontja¹³, mennyiség, mennyiség pénzneme, ár, ár pénzneme, előrefizetés, előrefizetés pénzneme és adott esetben az eszköz adatai.

- d) Javasolt, hogy 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 kereskedett¹⁴. 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 ügyfelnek történő eladást két külön saját számlás ügyletjelentésben szerepelteti. Hasonló az az eset, amikor a befektetési vállalkozás egy másik vállalkozással vagy befektetési vállalkozással több ügyletet összesítve hajt végre ügyletet: ilyenkor az a helyes, ha a másik vállalkozással vagy befektetési vállalkozással létrejött összesített ügyletet (piaci oldal) és az egyes ügyfelekhez való hozzárendelést (ügyfél oldal) bejelenti.
- e) Az a befektetési vállalkozás, amely adott kereskedési helyszínen ügyfél nevében saját számlára kereskedik, két ügyletjelentést nyújtson be: az egyiket a kereskedési helyszínnel létrejött (piaci oldal), a másikat pedig az ügyféllel teljesült ügyletről (ügyfél oldal). A saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végző, illetve az egyetlen ügyfél nevében "egyéb szerepben" eljáró befektetési vállalkozás egyetlen, a piaci és az ügyfél oldalt egyaránt tartalmazó ügyletjelentést nyújt be, melyben megjelenik az ügyfélre vonatkozó összes mező.



Client	Ügyfél
Client Side	Ügyfél oldal
Investment Firm X	X befektetési vállalkozás
Market Side	Piaci oldal
Investment Firm Y	Y befektetési vállalkozás
Investment Firm Y executed on venue	Y befektetési vállalkozás végrehajtási helyszíne
Trading venue	Kereskedési helyszín

¹² A kereskedési helyszínen végrehajtott ügylet piaci oldalára vonatkozóan (azaz az egyes ügyfelekhez való hozzárendeléssel szemben)

¹³ A befektetési vállalkozásokra vonatkozó különböző pontossági követelményeket lásd: jelen Ajánlás 63. pontja

¹⁴ Hacsak nem teljesíti a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításra vonatkozóan rögzített követelményeket, lásd jelen Ajánlás 37. pontja

13. Kereskedési szerep

- a) A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet (29. mező) rögzíti, hogy háromféle bejelenthető kereskedési szerep létezik: saját számlára történő kereskedés, saját kitettség nélküli ügyletpárosítás és "egyéb szerep". Az MNB elvárja, hogy a bejelentett kereskedési szerep tükrözze azt a szerepet, amelyben a befektetési vállalkozás ténylegesen kereskedett, és egyezzen a befektetési vállalkozás ügyletjelentéseiben található többi információval.
- b) Saját számlára történő kereskedés (DEAL): az MNB elvárja, hogy 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 helyszín¹⁵ lesz, akivel 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 vagy későbbi a piaci oldali jelentésben szereplő adattal, az árfolyam lehet azonos vagy eltérő.

ba) kereskedés saját néven:

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

X befektetési vállalkozás ügyletjelentése:

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>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-	

¹⁵ 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'	

bb) 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 ügyletjelentése:

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

16

¹⁶ Az 'XOFF' értéknek a helyszín mezőben való használatáról lásd a 15.pontban

XML-beli ábrázolás:

1. jelentés	2. jelentés
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890 1234567890</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>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</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.

X befektetési vállalkozás ügyletjelentése:

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> <LEI>12345678901234567890</LEI>
36	Helyszín	XOFF	</Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>

c) Saját kitettség nélküli ügyletpárosítás (MTCH):

ca) A MiFID II 4. cikk (1) bekezdés 38. pontja a saját kitettség nélküli ügyletpárosítást olyan ügyletként határozza meg, "ahol a befektetési vállalkozás a vevő és az eladó közé helyezi magát oly módon, hogy a tranzakció végrehajtása során nincs kitéve piaci kockázatnak (...)". Az MNB ezért javasolja, hogy az ügyletjelentésből derüljön ki, hogy a végrehajtó befektetési vállalkozásnak a pozíciója az ügylet eredményeképpen nem változik.

cb) 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 ügyletet az eladó, illetve vevő mezőbe, a kereskedési helyszínt vagy üzleti partnert pedig a vevő/eladó mezőbe kell felvenni. Ha az ügyletben résztvevő ügyletek száma egynél több, ajánlott a piaci oldalt az egyes ügyleteknek jutó allokáció összesített ügyfélszámla (lásd: megbízások csoportosítása az ajánlás 34. pontja alapján) segítségével a 61. példában bemutatott módon összekapcsolni, az ügyfél oldali jelentéseknek pedig ajánlott tartalmazniuk az összes vonatkozó mezőt.

cc) 4. példa: ha az a) pontban 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 nélküli 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>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</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	

d) Kereskedés "egyéb szerepben" (AOTC):

- da) A saját számlára történő kereskedés és a saját kitettség nélküli ügyletpárosítás fogalmi körébe nem tartozó összes egyéb tevékenység jelentésében ajánlott kereskedési szerepként az "egyéb szerep" értéket feltüntetni, ami arra az esetre is kiterjed, amikor a kereskedés ügynöki szerepben történik.
- db) 5. példa: 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 ügyletjelentése:

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <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> </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	'AOTC'	
33	Árfolyam	'0,352'	
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	

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

e) A kereskedési szerepek korlátozásai:

ea) A saját számlára kereskedő vagy saját kitettség 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 diszkrecionális 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 MNB elvárja, hogy az adott vállalkozás "egyéb szerep" szerint jelentsen.

eb) Az ajánlás 39. pontjának megfelelően a közvetlen elektronikus hozzáférést biztosító szolgáltatóknak javasolt azt bejelentenie, hogy AOTC vagy MTCH szerepben jár el.

14. Láncok és továbbítás:

a) Általános rendelkezések:

aa) Jelentési lánc akkor alakul ki, amikor egy vállalkozás vagy befektetési vállalkozás az ügyletet nem saját maga teljesíti, hanem a megbízás teljesítését egy másik vállalkozásnak vagy befektetési vállalkozásnak továbbítja. Ebbe a körbe tartozik az a helyzet, amelyben egy vállalkozás vagy befektetési vállalkozás:

(i) a saját megbízását küldi el egy vállalkozásnak teljesítésre;

(ii) az ügyfelétől kapott megbízást küldi el egy másik vállalkozásnak vagy befektetési vállalkozásnak teljesítésre, vagy

(iii) ügyfelétől kapott diszkrecionális megbízás alapján dönt egy pénzügyi eszköz megszerzéséről vagy elidegenítéséről, és a megbízást egy másik vállalkozásnál vagy befektetési vállalkozásnál helyezi el.

ab) Azt az esetet kivéve, amikor a megbízást a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikke szerint továbbítják, az ügyletjelentési kötelezettség 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 rendelvek 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 az Ajánlás 38. pontja). 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 túl jelenteni.

- ac) Amikor a lánc részét képző befektetési vállalkozás a 14. aa) pont (ii) és (iii) alpontja alapján végzi a tevékenységét, miközben a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében rögzített feltételek nem teljesülnek, az ügyletjelentés ugyanúgy történik¹⁷, mint amikor a befektetési vállalkozás az ügylet teljesítését közvetlenül egy kereskedési helyszínen vagy piaci üzleti partnerrel vagy ügyféllel végzi (lásd: az Ajánlás 37. pont aa) alpontja).
- ad) A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében a továbbításra vonatkozó feltételek a vállalkozásokra nem terjednek ki. Ezért, amikor egy befektetési vállalkozás egy vállalkozástól kap megbízást, vevőként, illetve eladóként azt a vállalkozást jelentse, amelyik a megbízást küldte, és ne a vállalkozás mögött álló ügyfelet. Az MNB jó gyakorlatnak tartja, ha a nem befektetési vállalkozásnak minősülő alapkezelőktől kapott megbízások esetében a megbízást átvevő befektetési vállalkozás az alapkezelő mögött álló alapot, illetve ügyfelet, vagy adott esetben az alapkezelőt jelöli meg ügyfélnek (vevő, illetve eladó).
- ae) A saját számlára kereskedő vagy saját kitettség 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.

b) Továbbítás:

- ba) Az a befektetési vállalkozás, amely a 14. aa) pont (ii) és (iii) alpontja szerinti tevékenységet végzi, választhat, hogy betartja a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt továbbítási feltételeket, vagy jelenti az ügyletet.
- bb) 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 töltse ki az ügyletjelentésében a táblázat mezőit. A fogadó vállalkozás ezt szokásos adatszolgáltatása részeként teszi, vagyis az adatszolgáltatás teljesítéséhez nem szükséges ARM-mé válnia.
- bc) A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet szerint (lásd 7. 16. és 25. mező) amikor a befektetési vállalkozás a 14. aa) pont (ii) és (iii) alpontjának megfelelő

¹⁷ Bár a megbízás továbbítását jelző mező kitöltése másképp történik.

tevékenységet végez, s eközben ugyanennek a rendeletnek a 4. cikkében a továbbításról rögzített feltételek nem teljesülnek, akkor a vállalkozás bejelenti az ügyletet, és a megbízás továbbítását jelző mezőben az "igaz" értéket tünteti fel. A fogadó befektetési vállalkozás a továbbító befektetési vállalkozást vevőként, illetve eladóként jelenti. Abban az 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 (lásd: az Ajánlás 37. pont f) alpontja).

- bd) Amikor a befektetési vállalkozás olyan kereskedési helyszínen saját kitettség nélküli ügyletpárosítást végez vagy saját számlára kereskedik, amely nem OTF, 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.
- be) 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.
- bf) 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 székhelye szerint illetékes hatóságnak küldi.
- bg) Egy 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.
- bh) 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 tünteti fel függetlenül attól, hogy a továbbításra sikertelen kísérletet tett-e, vagy egyszerűen eltekintett a továbbítástól.
- bi) A fentiek fényében a 25. mező kitöltése során az alábbiakat figyelembe vételét várja el az MNB:
 - Nem készít jelentést a befektetési vállalkozás, amikor megbízást továbbít, és a 4. cikk összes feltételét teljesíti.

- Amikor a befektetési vállalkozás közvetlenül olyan kereskedési helyszínen kereskedik, amely nem OTF, a 25. mezőben (Megbízás továbbításának jelzése) a 'false' (hamis) érték álljon.
- Amikor a befektetési vállalkozás szerepe szerint saját számlára kereskedik, vagy saját kitétséggel nélkül ügyletpárosítást végez (29. mező = 'DEAL' / 'MTCH'), a 25. mezőben (Megbízás továbbításának jelzése) a 'false' (hamis) érték álljon.
- 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.
- Bármely egyéb esetben, amikor a befektetési vállalkozás egyéb kereskedési szerepben jár el (29. mező = "AOTC"), a 25. mezőben a 'false' érték álljon.

15. Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen

- A 36. mező értelmezésében csak akkor minősül az ügylet egy kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletnek, amikor
 - a két fél vételi és eladási szándékát a kereskedési helyszínen kapcsolja össze akár diszkrecionális, akár nem diszkrecionális alapon, vagy
 - a két fél vételi és eladási szándékát a kereskedési helyszínen sem diszkrecionális, sem nem diszkrecionális alapon nem kapcsolja ugyan össze, de az ügyletre mégis kiterjednek a kereskedési helyszínen 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 végrehajtott vállalkozásnak.
- A kereskedési helyszínen ügyletazonosító kódja (3. mező)
 - A 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 12. cikke alapján "a kereskedési helyszínek üzemeltetői kötelesek egyedi kereskedési helyszínen ügyletazonosító kódot nyilvántartani" a párosítási rendszerükben feldolgozott megbízások teljes vagy részleges végrehajtása nyomán létrejött minden egyes ügyletről. A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben a 3. mező a kereskedési helyszínen ügyletazonosító kódra (TVTIC) hivatkozik, amely előírja, hogy a befektetési vállalkozás köteles ebben a mezőben a kereskedési helyszínen 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 az a) pont második bekezdése szerinti fogalomnak felelnek meg. Amennyiben a TVTIC kód előállítása e körülmények között történik és a befektetési vállalkozás a TVTIC

kódot a kereskedési helyszíntől kapja, 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.

- d) A helyszín mező kitöltése láncok esetében (36. mező): ha az ügyletjelentés olyan ügylethez készül, amelyet az a) pontban írt pontosítás szerinti kereskedési helyszínen, rendszeres internalizálón vagy az unión kívüli szervezett kereskedési platformon keresztül 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.

16. A felek azonosítói

- a) Az MNB elvárja, hogy 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 tartoznak¹⁸. A fióktelepet a központ LEI kódjával kell azonosítani még akkor is, ha egyes esetekben a fióktelep maga is jogosult lehet LEI kódra¹⁹.
- b) 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.
- c) A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 6. cikke kimondja, hogy a természetes személyt a II. mellékletében felsorolt nemzeti azonosítóval kell azonosítani. Fontos, hogy a MiFIR 26. cikk (1) bekezdésének rendelkezése szerint a befektetési vállalkozások mindenre kiterjedő 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 többek között javasolt, hogy a befektetési vállalkozás felszólítsa a természetes személyt, hogy hivatalos okmányok átadásával igazolja az azonosító helyességét és érvényességét. Amennyiben az ügyfél nem

¹⁸ Az üzleti minőségben eljáró magánszemély a MiFID II 4. cikk (1) bekezdés 1. pontja szerinti befektetési vállalkozásnak minősül. Az üzleti minőségben eljáró magánszemélyekkel kapcsolatos további részleteket lásd: LEI Szabályozás-felügyeleti Bizottságának nyilatkozata (http://www.lei.org/publications/gls/lou_20150930-1.pdf).

¹⁹ 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.lei.org/publications/gls/roc_20160711-1.pdf).

ad azonosítót, a befektetési vállalkozás képtelen az ügyletjelentési kötelezettségek e részletének eleget tenni.

d) 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 a több EGK állampolgársággal rendelkező személyeknél használt eljárással azonos módon tisztázni.

e) A CONCAT létrehozásának eljárása:

ea) A CONCAT kódot nem lehet 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.

eb) A CONCAT előállításához tanácsos az alábbi négylépéses eljárást alkalmazni:

- A vezetéknév 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 nem lehet használni.
- 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.
- 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. Nem lehet eltávolítani a vezetékeveknek 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.
- Aposztróf, ékezet, kötőjel, szóköz és hasonló jelek eltávolítása. A vezetékek 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.

ec) Átírási táblázat²⁰:

Kimenet	Bemenet:	Bemeneti Unicode kódpont
A	Ăă Ââ Áá Ãã Ää Åå Ăă Ââ Ãã Ää Åå	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	Çç Ćć Čč Ćć	U+00C7 U+00E7 U+0106 U+0107 U+0108 U+0109 U+010C U+010D
D	Đđ Ðð Ċċ	U+010E U+0111 U+0110 U+010F U+00F0
E	Êê Éé Êê Ëë Ěě Ėė	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	Ġġ Ģģ Ģģ	U+011C U+011D U+0122 U+0123 U+011E U+011F
H	Ĥĥ	U+0124 U+0125
I	İi Ĭî Ĭî Ĭî	U+00CC U+00EC U+00CD U+00ED U+00CE U+00EE U+00CF U+00EF U+0131
J	Ĵĵ	U+0134 U+0135
K	Ķķ	U+0136 U+0137
L	Łł Łł Łł	U+0139 U+013A U+013B U+013C U+0141 U+0142 U+013D U+013E
N	Ññ Ńń Ńń	U+00D1 U+00F1 U+0143 U+0144 U+0147 U+0148
O	Ōō Ōō Ōō Ōō Ōō 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	Ŕŕ Ŗŗ	U+0154 U+0155 U+0158 U+0159
S	Ŝŝ Ŝŝ Ŝŝ Ŝŝ Ŝŝ	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	Ţţ Ţţ Ţţ Ţţ	U+0164 U+0165 U+0162 U+0163 U+00DE U+00FE U+021A U+021B
U	Ūū Ūū Ūū Ūū Ūū ū Ū Ū Ū Ū	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	Ŵŵ	U+0174 U+0175
Y	Ŷŷ Ŷŷ Ŷŷ	U+00DD U+00FD U+0178 U+00FF U+0176 U+0177
Z	Žž Žž Žž	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	

²⁰ A 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.

ed) Válogatott példák²¹:

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.

f) 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 16. e) pont eb) alponjában ismertetett módszer első ("A vezetéknév és utónév beszerzése"), majd a második lépését ("Címek eltávolítása"). Tehát az átírást nem kell alkalmazni, és az előtagokat sem kell eltávolítani. Az EU országokban érvényes bármely karakter, akár a mellékjellel kiegészülő változat is használható. Az előtag, az utónév és a vezetéknév összes betűjét nagybetűvel írjuk.

²¹ Megjegyzendő, hogy ezek a példák csak akkor érvényesek, ha a nemzetiazonosító CONCAT. A legtöbb ország esetében magasabb prioritást élvező egyéb azonosítók elváltak a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet (6. cikk (2) bekezdés) szerint.

17. Az ügylet fogalma

a) Szerzés és elidegenítés:

aa) Az MNB-nek a piaci visszaélések kiszűrése érdekében információval kell rendelkeznie a pénzügyi eszközök tulajdonának változásáról. 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.

ab) 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: az Ajánlás 25. pont f) alpontjában.

b) Kizárások a jelentésből:

ba) 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 SFTR alapján jelenti be. Ügyletjelentési kötelezettsége egyik befektetési vállalkozásnak sincs, hiszen az ügylet bejelentése az SFTR alapján megtörtént.
- 7. példa: egy kollektív befektetési vállalkozás nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozás államkötvényre vonatkozó repomegállapodást köt. Tételezzük fel, hogy az SFTR 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.

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

bca) 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.

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

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

bda) 8. példa: egy letétkezelő/meghatalmazott úgy dönt, pénzügyi eszközöket helyez át az egyik letétkezelő bankból egy másik letétkezelő bankba.

A pénzügyi eszköz ilyen mozgása nem tartozik az ügyletjelentési kötelezettség hatálya alá, mert ez a tevékenység kizárólag a letétkezelői tevékenység eredményeként merült fel.

bdb) 9. példa: az egyik ügyfél letétkezelőnek/meghatalmazottnak utal át pénzügyi eszközöket, hogy azokat a letéti/megbízotti számlán vezesse.

Ez az átutalás nem tartozik az ügyletjelentési kötelezettség hatálya alá, mert kizárólag a letétkezelői tevékenységgel kapcsolatos.

be) 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 ügyletben résztvevő egyik fél 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.

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

bfa) A 2. cikk (5) bekezdésének g) pontja szerint nem minősül ügyletnek a "kollektív befektetési vállalkozás befektetési jegyeinek a kollektív befektetési vállalkozás általi kibocsátása vagy visszaváltása".

bfb) 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.

bfc) 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.

bfd) 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 hajt 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 vagy kezelője részére, mert a kibocsátási folyamat részét képezi.

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

bga) Amikor a pénzügyi eszközt, például opciót, fedezett warrant, átváltható vagy beváltható 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 lehívják²².

bgb) 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.

bgc) 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 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.

bgd) 12. példa: A pénzügyi eszköz vagy átváltható kötvény jogosultja lehívja a pénzügyi eszközt, vagy átváltja az átváltható 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

²² 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.

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.

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

bha) A 2. cikk (5) bekezdésének i) pontjában rögzített kizárás alól kivételt jelent és jelentendő az, amikor a 2. cikk (5) bekezdésének i) pontjában írt tevékenységek első nyilvános részvénykibocsátással, másodlagos nyilvános részvénykibocsátással vagy értékpapír-kihelyezéssel vagy hitelviszonyt megtestesítő értékpapír kibocsátásával kapcsolatosak.

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

bhc) Nem jelentendő az, amikor a megszerzés vagy az elidegenítés fúzióval, felvásárlással, a Tanács 1346/2000/EK rendelete szerinti fizetéseképtelenségi eljárással²³, részvényfelosztással vagy részvényösszevonással kapcsolatos. Ezekben a helyzetekben a feltételeket a közgyűlésen rendszerint előre rögzítik, a vonatkozó tájékoztató hirdeteményeken kifüggesztik, és a befektetőre az ilyen megállapodás a befektető további döntése nélkül kiterjed.

bhd) 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.

bhe) 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.

bhf) Jelentendő azonban az olyan esemény, amelynél a befektető a kibocsátás, a lejárat vagy a visszaváltás időpontjában döntést 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.

bhg) 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)

²³ A TANÁCS 1346/2000/EK rendelete (2000. május 29.) a fizetéseképtelenségi eljárásról

befolyásolási körén kívül eső előre meghatározott szerződéses feltételekből következik.

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

bia) 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.

bj) Kizárások 2. cikk (5) bekezdés m) pontja alapján:

Ez a kizárás nem vonatkozik a blokkmegbízások (ügyletek 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.

bja) 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 szeptemberben 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.

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

bka) 15. példa: Egy társaság tender ajánlatot tesz kötvényeinek feláron történő visszavásárlására. Az ajánlat feltételei 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.

18. A bejelentés mechanizmusa

- a) Az ajánlás I. melléklete ismerteti azt a módszert, ahogy az MNB a bejelentő jogalanyok jelentéseit feldolgozza.
- b) Nem alkalmazandó mezők és az eszközök referenciaadat-mezőinek kitöltése:
- ba) Amikor a mezők táblázata azt jelzi, hogy egy adott mezőt a hozzá tartozó ismertetés vagy a 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 EÉPH 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.
- bb) 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 EÉPH referenciaadatok listáján. Amennyiben a fentiek közül valamelyik feltétel teljesül, a befektetési vállalkozásnak nem szükséges ezeket a mezőket kitöltenie. Emellett az EÉPH 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.
- bc) 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 EÉPH referenciaadat listáján²⁴. 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.

²⁴ Abban a valószínűtlen esetben, amikor a kereskedési helyszín az eszköz referenciaadatokat nem küldi meg az EÉPH részére.

Ugyanakkor az MNB ügyletjelentést nem utasít vissza amiatt, hogy a befektetési vállalkozás kitöltötte a referenciaadat-mezőket, holott az ügylet kereskedési helyszínen realizálódott, vagy szerepel az EÉPH listán.

c) Ügyletjelentések benyújtása:

ca) A MiFIR 26. cikk (7) bekezdése szerint a befektetési vállalkozás egy adott kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek piaci oldalának bejelentését illetően a kereskedési helyszínrre 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.

cb) 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 székhelye.

cc) 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 saját illetékes hatóságához nyújtsa be.

cd) Az ügyletjelentések benyújtásának határideje:

- Adatszolgáltatás időzítése: az ügyleteknek az MNB felé²⁵ legkésőbb 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 MNB részére a T+1 napos határidőn belül be tudják nyújtani.
- Munkanap: a hét minden napja, a szombat és a vasárnap, valamint a nemzeti ünnepek kivételével.

²⁵ Illetve a kereskedési helyszín saját illetékes hatóságához, amennyiben a kereskedési helyszín nem befektetési vállalkozásnak minősülő tagja nevében közöl adatot.

III.2. II. fejezet – Blokkok

19. 1. blokk: Eladó, illetve Vevő azonosítása

- a) Az MNB-nek a piaci visszaélések megállapítása céljából információval kell rendelkeznie arról, hogy egy ügylet mögött ki áll ügyfélként. 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.
- b) Ugyanakkor az olyan átruházást kivéve, amely a 4. cikkben az átruházásra vonatkozóan rögzített, és az Ajánlás 37. pont f) alpontjában 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, illetve 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. Érdemes megjegyezni, hogy az alább ismertetett üzleti esetek a vevők azonosítását és kiegészítő adatait mutatják, de ugyanez a megközelítés érvényes az eladókra is.
- c) A LEI-kódra jogosult vevő/eladó az lehet, aki a piacon üzleti partnerként fellépő vállalkozás vagy befektetési vállalkozás; központi szerződő fél (akkor érvényes, amikor az ügylet kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben központi szerződő féllel jön létre); rendszeres internalizálóként fellépő befektetési vállalkozás; illetve LEI-kódra jogosult ügyfél (a felek azonosítását lásd az Ajánlás 16. pontjában):
- ca) 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	<pre> <Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx> </pre>
9	Vevő utónevei		
10	Vevő vezetéknévei		
11	Vevő – születési dátum		

d) Amennyiben a Vevő/Eladó EGK állampolgár egy állampolgársággal, úgy 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 a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 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:

da) 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> ... <Buyr> <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> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx>
9	Vevő utónevei	"JOSE,LUIS"	
10	Vevő vezetécknevei	"RODRIGUEZ,DE LA TORRE"	
11	Vevő – születési dátum	1976.02.27.	

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 ügyfélaazonosító használatára utal. A "CCPT" érték az útleveleszám használatára utal, míg az állampolgárság, a születési idő és a rövidített név összevonását a "CONCAT" rendszernév jelzi. A bekezdés után bemutatott két példa mind a három esetet szemlélteti.

e) Vevő/Eladó nem-EGK állampolgár (egy állampolgársággal):

ea) 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 vezetéknévei	"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.

f) Vevőnek/Eladónak kettős állampolgársága van (két EGK országban):

fa) 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 vezetéknévei	"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>
----	------------------------	-------------	---

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

ga) 21. példa: X befektetési vállalkozás ügyletet hajt végre egyik ügyfele, 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.	

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

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.

20. 2. blokk: Az Eladó, illetve Vevő nevében döntést hozó személy

- a) 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.
- b) 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 joggal természetes vagy jogi személy ügyfél és olyan személy rendelkezhet, aki meghatalmazás alapján az ügyfél nevében természetes vagy jogi személyként eljárhat.
- c) Amennyiben ez a harmadik fél a befektetési vállalkozás, a 12. mezőben a befektetési vállalkozásnak és ne a befektetési vállalkozás által foglalkoztatott egyedi döntéshozónak az azonosítója álljon (az egyedi döntéshozóra az 57. mező vonatkozik). Ez akkor 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.
- d) Abban az esetben, ha az eladó, illetve vevő több személynek adott képviseleti jogot, a döntéshozót jelölő mezőbe az az egy vagy több személy kerüljön, aki a befektetési vállalkozásnak az utasítást adta.
- e) Minden egyéb esetében 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.

- f) Az ajánlás és a tanács nem minősül befektetési döntésnek, ezért ahol csak ajánlásra vagy tanácsadásra kerül sor, ott maradjon a döntéshozóval kapcsolatos mező üresen.
- g) Az alapok és az alapkezelők konkrét esetében a megbízását végrehajtó befektetési vállalkozás az alapkezelő mögött álló alapot, illetve ügyfelet, vagy adott esetben az alap kezelőjét azonosítsa vevőként, illetve 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.
- h) A döntéshozó a Vevő/Eladó:

ha) 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 vezetéknévei		
11	Vevő – születési dátum		
12	Vételi döntéshozó kódja		
13	Vételi döntéshozó – valamennyi utónév		
14	Vételi döntéshozó – valamennyi vezetéknév		
15	Vételi döntéshozó – születési dátum		

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

- i) A döntéshozó olyan harmadik fél, aki a Vevőtől, illetve Eladótól képviseleti jogot kapott:
- ia) 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 vezetécknevei	"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 vezetéknév	"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.

- ib) A döntéshozó az Eladó, illetve 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 döntést 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 vezetéknévei	"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 vezetéknév		
15	Vételi döntéshozó – születési dátum		

21. 3. blokk: (Az 1. és a 2. blokk együtt) Eladóra/Vevőre és döntéshozóra vonatkozó forgatókönyvek

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

aa) 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 (útlevélszáma: 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	<pre> <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> </pre>
9	Vevő utónevei	"PIERRE" "MARIE"	
10	Vevő vezetéknévei	"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 vezetéknév	'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.

- b) Elhalálozott ügyféllel vagy örökséggel kapcsolatos hagyatéki végzéséből származó ügyletek esetén az elhunytat jelöljék 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.

22. 4. blokk: A vállalkozáson belüli befektetési döntés mező

a) A vállalkozáson belüli befektetési döntés:

aa) 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: az Ajánlás 37. pont f) és g) alpontok és 38. pont d) alpont).

ab) 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 (lásd: az Ajánlás 38. pont a) alpontja).

ac) 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>

- ad) 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.
- ae) Ahol a befektetési vállalkozásnál elsősorban egy algoritmus hozza a befektetési döntéseket, az 57. mezőben az algoritmus kódja szerepeljen.
- b) A befektetési vállalkozáson kívül hozott befektetési döntések (a befektetési döntést az ügyfél hozza, a befektetési vállalkozás pedig saját kitettséggel nélkül ügyletpárosítást végez vagy "egyéb szerepben" jár el):
- ba) 27. példa: X befektetési vállalkozás saját kitettséggel nélkül ügyletpárosítás révén vagy "egyéb szerepben" eljárva pénzügyi eszközt vásárol olyan ügyfélnek, akinek a nevében kizárólag végrehajtást végez, vagy tanácsadói alapon jár el. Itt azt 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 kitettséggel 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> <i>Ha a mezőben nem szerepel adat, a vonatkozó XML elem (tehát a <InvstmtDcsnPrsn>) maradjon ki az üzenetből.</i>

- bc) 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.

23. 5. blokk: Végrehajtás a vállalkozáson belül mező

- a) 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.
- b) 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>

- c) 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.
- d) Abban az esetben, amikor a végrehajtásért az elsődleges felelősség a személyt terheli, az 59. mezőben az adott személy nemzeti azonosítója álljon.
- e) 29. példa: Ha a végrehajtást algoritmus bonyolította, a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. sz. melléklékének 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>

- f) Az "algoritmus" 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.

24. 6. blokk: Kereskedés dátuma és időpontja

- a) 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.
- b) 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.
- c) 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.
- d) Az ügyletjelentések pontosságára vonatkozó követelményeket lásd az időbélyegző pontosságával foglalkozó 63. pontban.

25. 7. blokk: Helyszín

- a) 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 mező az Ajánlás 15. pont d) alpontjában adott magyarázat szerint akkor helyes, ha csak a kereskedési helyszín²⁶, a kereskedési platform vagy a rendszeres internalizáló közvetlen végrehajtását azonosítjuk a helyszínen történt végrehajtásként. A helyszín mező egyéb helyzetekben való kitöltésének példáit az Ajánlás 33-35. pontjai és a 37-38. pontjai ismertetik (a többszörös végrehajtás forgatókönyveiről, a megbízások csoportosításáról, a saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végző szervezett kereskedési

²⁶ Ide tartoznak azok az esetek is, ahol a kereskedési helyszínen kívül megállapodott ügyletekre a kereskedési helyszín szabályai lesznek érvényesek.

rendszerrel és a befektetési vállalkozások láncolatában történő végrehajtásról, a szállításról és a diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozásról). A IV. fejezet mutatja be, hogy konkrét pénzügyi eszközökben létrejött ügyleteket hogyan tanácsos bejelenteni.

b) Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben. 30. példa: 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 helyszín létrehozta a kereskedési helyszín ügyletazonosító kódját (TVTIC) (ABCDEFGH123456).

- M kereskedési helyszín (amely központi szerződő felet használ),
- B kereskedési helyszín 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 helyszín mezőben a befektetési döntést?

N	Mező	a). értékközlés	b) 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	B kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-05-05T09:10:33.124Z'	'2018-05-05T09:10:33.124Z'
36	Helyszín	M. kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	B kereskedési helyszín 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> <TradPlcMchglId>ABCDEFG123456</TradPlcMchglId> </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> <TradPlcMchglId>ABCDEFG123456</TradPlcMchglId> </Tx> ... </New> </pre>
	<pre> </Tx> </pre>

- c) 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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ...
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-09-10T13:15:45Z'	<Tx> <TradDt>2018-09-10T13:15:45Z</TradDt> ...
36	Helyszín	A kereskedési platform szegmensazonosító {MIC} kódja	<TradVn>XAAA</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

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

- e) 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.

- f) Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen anonim ajánlati könyvben szereplő saját ajánlat leütésével:

fa) Az Ajánlás 17. pontjában az 'Ügylet fogalma' alatt már említésre került, hogy ez az a helyzet, amelyre a 2. cikk (4) bekezdésének rendelkezése a jogalkotó szándéka szerint vonatkozik.

fb) 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> ... <TradPlcMtcHgld>ABCDEFG123456</TradPlcM tchHgld> </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> ... <TradPlcMtcHgld>ABCDEFG123456</TradPlcM tchHgld> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

- g) 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	2. 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> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> </New> </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> ... <TradDt>2018-07- 15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> </New> </Tx> </pre>

26. 8. blokk: Short ügylet jelölése

- a) 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 rövidre²⁷ saját számláról vagy ügyfél nevében. A befektetési vállalkozás kérdezze meg ügyfelét, hogy short ügyletet hajt-e végre számára.
- b) Ha az ügyfél a short ügyletről nem ad tájékoztatást a befektetési vállalkozásnak, akkor a 62. mezőben az 'UNDI' (nincs tájékoztatás) érték álljon.
- c) 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.
- d) Lásd még az Ajánlás 34., 35. és 38. pontjait arról, hogyan alkalmazzuk a short ügylet megjelölést olyan esetekben, ahol összesítésre kerül sor.
- e) A befektetési vállalkozás ügyfele rövidre ad el (X vállalkozásnak erről tudomása van). 34. példa: X befektetési vállalkozás A ügyfél nevében részvényeket ad el. Az 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... </pre>
16	Az eladó azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </pre>
18	Eladó – utóneve(i)		
19	Eladó – vezetéknéve(i)		
20	Eladó – születési dátum		
62	Short ügylet megjelölése	'SESH'	<pre> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>

²⁷ A 2346/2012/EU rendelet 2. cikke (1) bekezdésének b) pontja szerint.

f) X befektetési vállalkozás saját számlán rövidre ad el. 35. példa: X befektetési vállalkozás saját számlán rövidre ad el állampapírt:

fa) 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SSEX</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> ... </New> </Tx> </pre>
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	
62	Short ügylet megjelölése	'SSEX'	

fb) 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	<Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
62	Short ügylet megjelölése	'SESH'	

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

a) Mentesség és OTC kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés:

- aa) A 61. mezőt az a befektetési vállalkozás töltse ki, amely az ajánlatot a kereskedési helyszínre beadta, illetve az ügyletet a kereskedési helyszínnek jelentette.
- ab) 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.
- ac) Kereskedési helyszínen végrehajtott ügylet. 36. példa: X befektetési vállalkozás saját számlán hajt végre ügyletet egy ügyfél számára. Az eszköz részvény instrumentum. X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínen veszi meg a pénzügyi eszközt, majd eladja azt az ügyfélnek. A kereskedési helyszínen 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 helyszínen 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 belső 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>

ad) 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 nagyobb, 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	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 belső 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> <Wvrlnd>RFPT</Wvrlnd> ... </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>

ae) 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 helyszínnak 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 helyszínnak 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>ABCDEFGHJKLMN OPQRST</ExctgPty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</ExctgPty> </pre>
<pre> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> ... <LEI>AAAAAAAAAAAAAA AAAA</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> <WvrInd>OILQ</WvrInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> ... <LEI>AAAAAAAAAAAAAA AAAA</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>

- b) Kereskedés utáni közzétételhez kapcsolódó megjelölés jelzése olyan esetben, ahol a befektetési vállalkozás két ügyfél ajánlatait OTC piaconpárosítja:

Lásd: jelen Ajánlás 31. pontja.

- c) Árualapú származtatott termék megjelölése:

- ca) 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)	... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> ... </AddtlAttrbts> </New> ... </Tx>

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.

- cb) 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.

28. 10. blokk: Fióktelepek

- a) 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 tagsága²⁸. Az ügyletjelentést a (holland) AFM-nek nyújtják be. Hogyan töltse ki D vállalkozás és E ügyfél a fióktelepre vonatkozó mezőket, amennyiben E ügyfélnek ügyleti adatszolgáltatási kötelezettsége van és saját számlára kereskedik?

²⁸ Egyes joghatóságokban van mód arra, hogy a (helyi) fióktelep legyen a piac tagja, sőt egyes esetekben ez a szokásos eljárás.

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'	
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>24242424242424242424</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> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>QQ123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>24242424242424242424</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>24242424242424242424</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>13579135790246802468</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </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> </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.

b) 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 12312312312312312312, 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 töltse ki E befektetési vállalkozás a fióktelepre vonatkozó mezőket?

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

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	<pre> <ExctgPty>12312312312312312312</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12312312312312312312</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <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> </pre>
8	A fióktelep helye szerinti ország a vevő esetében		
16	Az eladó azonosító kódja	E befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
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'	

- c) 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>22222222222222222222</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>22222222222222222222</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> ... </Prsn> </ExctgPrsn> ... </pre>
7	A vevő azonosító kódja	F vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
8	A fióktelep helye szerinti ország a vevő esetében		
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínehez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
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'	
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország	'US'	
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa	'US'	
			<pre> </New> </Tx> </pre>

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.

29. 11. blokk: Az ügyletjelentések státusza és javítása

- a) 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.
- b) 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.
- c) 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 ismételten 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 ismételten felhasználjuk. Előfordulhat, hogy ugyanahhoz az ügyletnek egynél több (új vagy törölő) 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);
- a fenti körülmények kombinációi (azaz egy ügyletkezeg 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.

d) Törlés és módosítás adott napon belül:

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

db) 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.

e) 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	'NEW'	<pre> <Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1 ARM1</SubmitgPty> ... <Tx> <TradDt>2018-03- 10T12:45:30Z</TradDt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre> Érdemes megjegyezni, hogy az 1. mező nem XML elemként szerepel az üzenetben. Helyette a New vagy a Cxl címke használatos.
2	Az ügylet referenciaszáma	'ETYRU9753'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	ARM 1 jogalany-azonosító {LEI} kódja	
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-03-10T12:45:30Z'	

- f) Törlés benyújtása. 45. példa: X befektetési vállalkozás új ügyletjelentést nyújt be (részleteket lásd: jelen Ajánlás 29. pont e) alpontja) 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> Érdemes megjegyezni, hogy az 1. mező nem XML elemként szerepel az üzenetben. Helyette a New vagy a Cxl címke használatos.	<pre><Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </Cxl> </Tx></pre> Érdemes megjegyezni, hogy az 1. mező nem XML elemként szerepel az üzenetben. Helyette a New vagy a Cxl címke használatos.

g) Ügyletjelentés információinak helyesbítése:

- ga) Ahhoz, hogy egy ügyletjelentésben bizonyos információkat helyesbíteni lehessen, előbb törölni kell az eredeti jelentést, és egy újat kell benyújtani.
- gb) Törlés esetében csak az alapvető mezőket, azaz az 1., 2., 4. és 6. mezőt szükséges kitölteni. Visszautasításra kerül az olyan törölő ügyletjelentés, amely a fenti négy mezőn kívül egyéb mezőket is tartalmaz.
- gc) A helyettesítő jelentésben viszont szerepeltetni kell a bejelentett tranzakcióra vonatkozó összes mezőt.
- gd) 46. példa: X befektetési vállalkozás az 29. pont e) alpontjában 5 GBP árfolyamon ügyletet hajtott végre, de az ügylet árfolyamát nem fő pénznemegységben (font helyett pennyben) jelentette. Az ügyletjelentést a következő napon 14:50:20-kor törli, és egyben egy helyettesítő jelentést is benyújt, amelyben az árfolyam helyesen szerepel. 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>

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. Érdekes azt is megjegyezni, és ez az ajánlásra 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 kivonatossan mutatják be.

30.12. blokk: Névleges érték változása

- a) 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 kamatszervény, 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	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 árbrázolás:

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

- b) 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 kamatszelvény 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>ABCDEFGHJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>399987981</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </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.

c) Névleges érték csökkenése:

ca) 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 állapodnak 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	Számaztatott termék névleges értékének növekedése/csökkenése	'DECR'	'DECR'
33	Árfolyam	'100'	'100'
38	Előleg	'37500'	'37500'

XML-beli árbrázolás:

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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>39998792</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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> <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 kitettség 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 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 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.

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

III.3. III. fejezet – Kereskedési forgatókönyvek

31. Értékpapírok átvezetése

a) Átvezetés azonos vállalkozás ügyfelei között:

- aa) Az I. fejezetben 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.
- ab) 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.
- ac) 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.
- ad) 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.
- ae) 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 kedvezményezettől egy másikra száll át.
- af) 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.
- ag) 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> > </pre>
7	A vevő azonosító kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> ... <Buyr> <AcctOwnr> </pre>
16	Az eladó azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	<pre> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>
33	Árfolyam	'NOAP'	<pre> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> —Figyelem! Ha az ár nem értelmezhető, a NOAP kódot használjuk. </pre>

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

- b) 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
			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> Note: NOAP code should be used when price is not applicable. </pre>	<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> Note: NOAP code should be used when price is not applicable. </pre>

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.

c) Két ügyfél megbízásait OTC piacon párosító vállalkozások:

ca) 51. példa: X befektetési vállalkozás tőzsdén kívül hajt végre ügyletet A ügyfél, mint vevő és B ügyfél, mint eladó között. Egyik ügyfelet sem terheli ügyleti adatszolgáltatási kötelezettség. Az ügyletet annak létrejötte után közzé kell tenni, azért az OTC ügylet utólagos közzétételének jelzését 'ACTX' (ügynökségi keresztügylet) 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	A ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	B ügyfél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
36	Helyszín	'XOFF'	
63	OTC ügylet utólagos jelzése	'ACTX'	

- cb) 52. példa: X befektetési vállalkozás tőzsdén kívül hajt végre ügyletet A ügyfél, mint vevő és B ügyfél, mint eladó között. B ügyfelet 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 üzleti adatszolgáltatási kötelezettség, akkor ügyletjelentésében X befektetési vállalkozást, mint eladót kellene azonosítania.

32. Közvetítő befektetési vállalkozás ügyletjelentése

- a) 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> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</E xctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

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

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.

33. Egy ügyfél egyetlen megbízásának végrehajtása több ügyletben

- a) Ügyfél megbízásának teljesítése kereskedési helyszínen, majd az ügyfél kiszolgálása a befektetési vállalkozás saját könyvéből. 55. példa: A ügyfél 500 részvényt 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.



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

- aa) 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> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> </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</TradgCpcty> <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</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA 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> ... </New> </Tx> </pre>

ab) 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>1111111111111111111</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</ExctgP ty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1111111111111111111</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> </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 kitettség nélkül ügyletpárosítást végez.

ac) 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.

b) 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 átlagárát kíván kapni. X befektetési vállalkozás A ügyfél megbízását az alábbiak szerint teljesíti:

- 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 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>123456789012345 67890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1111111111111111111 1</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T14:25:13.159Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890< /LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Id><LEI>1111111111111111111 111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:55:13.746Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpct y> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789012345 67890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:24:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgC pty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">82.833333333333 33</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>

34. Megbízások csoportosítása

- a) 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') átvezetés 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.
- b) 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: jelen Ajánlás 35. pontja és a 38. pont d) alpontja).
- c) 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 allokalja.
- ca) 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>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</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</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09- 16T09:35:10Z</TradDt> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... <Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx> </pre>	<pre> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 16T09:35:10Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>UNDI</ShrtSellgInd> ... </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: jelen Ajánlás 38. pont d) alpontja).

cb) 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>123456789012345 67890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 1</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>1234567890123456 7890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09- 16T09:20:15.374Z</TradDt> ... </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234 567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBBB</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.

- d) 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 allokálna az ügyfelekre.
- da) 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> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx> </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> </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">99.333333333333 3</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... <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, mikor allokalta a vállalkozás a pénzügyi eszközöket az ügyfeleknek.

db) 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> <IntI>INTC</IntI> </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> <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> <IntI>INTC</IntI> </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> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </pre>
	</Tx>

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>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB BBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC CCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </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.

- dc) A befektetési vállalkozás saját kitettség nélküli ügyletpárosítást végez X befektetési vállalkozás nem alkalmazhatja a 'MTCH' értéket, amikor eltérő kereskedési időpontokkal hajtja végre az ügyleteket.
- dd) 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> </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> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </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>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </pre>

<pre> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="SEK">93.33333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="SEK">93.33333333333333 </Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09- 15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp Cpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="SEK">93.333333333333 33</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
---	---	---

Az ügyfél allokációkhoz tartozó kereskedés dátuma és időpontja az első piaci végrehajtás dátuma és időpontja. A piaci végrehajtás dátumának és időpontjának pontosságához ragaszkodni kell az ügyfélallokációkról benyújtott jelentésben, mivel az ügyleteket a vállalkozás "egyéb szerepben" hajtotta végre.

de) X befektetési vállalkozás "egyéb szerepben" eljárva több ügyletet hajt végre különböző napokon. 60. példa: 2018. július 24-én X befektetési vállalkozás A ügyféltől 400, B ügyféltől 600 darabra szóló megbízást kap. A megbízást az alábbi három részletben teljesíti: 2018. 07. 24-én 15:33:33-kor 100,21 euró árfolyamon 200 darab (üzleti partner: Y befektetési vállalkozás); 2018. 07. 24-én 17:55:55-kor 100,52 euró árfolyamon 300 darab (üzleti partner: Z befektetési vállalkozás); 2018. 07. 25-én 13:11:11-kor 100,96 euró árfolyamon 500 darab (üzleti partner: V befektetési vállalkozás, jogalany-azonosítója VVVVVVVVVVVVVVVVVVVVVV). Hogyan jelentse be X befektetési vállalkozás az ügyletek piaci oldalát és az utána következő allokációt?

dea) Az ügyfelek átlagárat kapnak: Ugyan a megbízást nem sikerül teljes egészében teljesíteni, az ügyfelek számára mindegyik nap végén kell allokálni, mert az 'INTC' számla egy napon túl nem mutathat pozícióváltozást.

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 AAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678 901234567890</Exct gPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB BBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </pre>
<pre> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</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>8888888888888 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> <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>

deb) 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>

<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</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>888888888888888888888888</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</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<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</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.365</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<LEI>BBBBBBBBBB BBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.52</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>
---	---	--	---

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

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
4	A végrehajtó 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> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <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>
16	Az eladó azonosító kódja	V vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
28	Kereskedés dátuma és időpontja	'2018-07-25T13:11:11Z'	
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	
30	Mennyiség	'500'	
33	Árfolyam	'100,96'	
36	Helyszín	'XOFF'	

35. Szervezett kereskedési rendszer (OTF) saját kitettség nélküli ügyletpárosítása

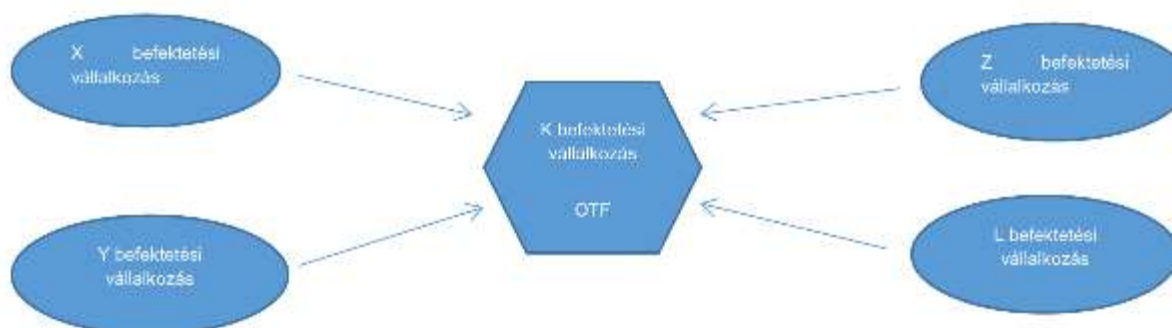
- a) Amikor egy ETF saját kitettség nélküli ügyfélpárosítást végez, hasonlóan készíti el jelentését, mint egy befektetési vállalkozás. A szervezett kereskedési rendszerrel kereskedő összes fél és az ETF a helyszín mezőben az ETF szegmensazonosító kódját szerepelteti. A saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végző ETF egy vagy több ügyfél vételi oldalon szereplő ajánlatát párosítja egy vagy több ügyfél eladási oldalon szereplő ajánlatával.
- b) 61. példa: K befektetési vállalkozás, amely egy saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végző ETF (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.



ba) 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 FOTFOTFOTFOTFOT OT</ExctgPty> ... <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 jelen Ajánlás 34. pontja.

bb) 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- 09T16:41:07.12 3Z'	'2018-06- 09T16:41:07.123 Z'	'2018-06- 09T16:41:07.12 3Z'	'2018-06- 09T16:41:07.12 3Z'
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 szegmensazono- sító {MIC} kódja'	K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazonos- ító {MIC} kódja'	K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazono- sító {MIC} kódja'	K befektetési vállalkozás/OTF szegmensazono- sító {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'

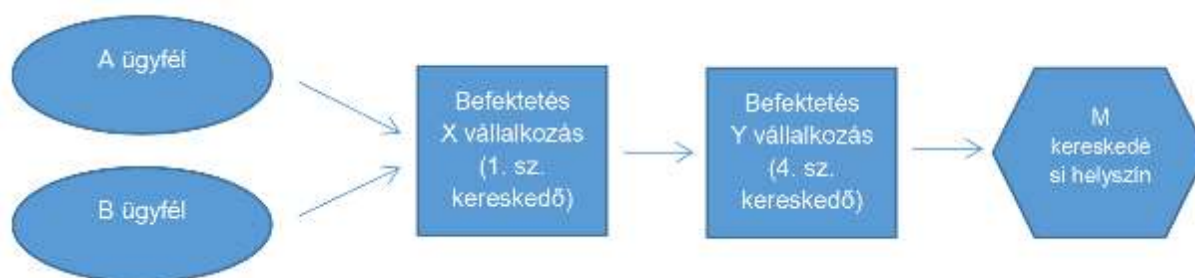
XML-beli ábrázolás:

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 IJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLM NOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>888888888 888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT FOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>8888888888888 888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>7777777 777777777777</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOT OTFOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>77777777777 777777777</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </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>	<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>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<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> </Prsn> </ExctgPrsn> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<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> </Prsn> </ExctgPrsn> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
--	--	--	---

36. Értékalapú ügyletek kiegyenlítő egységgel

- a) Ez ott fordulhat elő, ahol a befektetési vállalkozás lakossági ügyfeleinek költséghatékony lehetőségként napi összesített kereskedést kínál.
- b) 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> </Sellr> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </Sellr> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </Sellr> </Tx> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </Sellr> </Tx> </pre>

KLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<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</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Algo>ALGOABC</Algo> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Algo>ALGOABC</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<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</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
--	--	---	---

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.

37. Láncok és továbbítás

a) Ez a bekezdés az alábbiakkal kapcsolatosan közöl példákat:

- Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek nem teljesülnek,
- Olyan láncok, ahol a 4. cikk (1) bekezdésének a) és b) pontjában írt feltételek teljesülnek, de a 4. cikk nem minden feltétele teljesül,
- Olyan láncok, ahol továbbítás valósul meg, és a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek az összes befektetési vállalkozás megfelel,
- Olyan láncok, ahol a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkében írt feltételeknek csak néhány befektetési vállalkozás felel meg.

A láncok és a továbbítás általános ismertetését lásd az I. fejezet megfelelő bekezdéseiben.

b) 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' algoritmusra M kereskedési helyszínt választja ki, hogy oda küldjék be a megbízást. Ekkor a megbízást Z befektetési vállalkozás M kereskedési helyszín ajánlati könyvében 2018. július 1-én 13:40:23.4672-kor 32,5 euró árfolyamon teljesíti. M kereskedési helyszínen az ügylet az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli.



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

da) 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 kitettség nélkül ügyletpárosítást végez vagy saját számlára kereskedik. Ennek a láncnak az általános ismertetését lásd a jelen Ajánlás 14. pontjában.

db) 64. példa: Y és Z befektetési vállalkozás saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végez, X befektetési vállalkozás pedig saját számlára kereskedik. X, Y és Z befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	1. értékközlés Z befektetési vállalkozás	1. értékközlés Y befektetési vállalkozás	1. értékközlés X befektetési vállalkozás	2. értékközlés X befektetési vállalkozás
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	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- 01T13:40:23 Z'	'2018-07- 01T13:40:23 Z'	'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 szegmensaz onosító {MIC} kódja	'XOFF'	'XOFF'	'XOFF'
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés			1. kereskedő {NATIONAL_ ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_I D}-ja
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	{az algoritmus kódja}	4. kereskedő {NATIONAL_ ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_ ID}-ja	1. kereskedő {NATIONAL_I D}-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> ... <ExctgPty>888888888	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGG	<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678

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

<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 kitettség 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 a jelen Ajánlás 63. pontját. 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 pontossáig kötelező az időpontot megadni (bár nagyobb felbontásban is lehet).

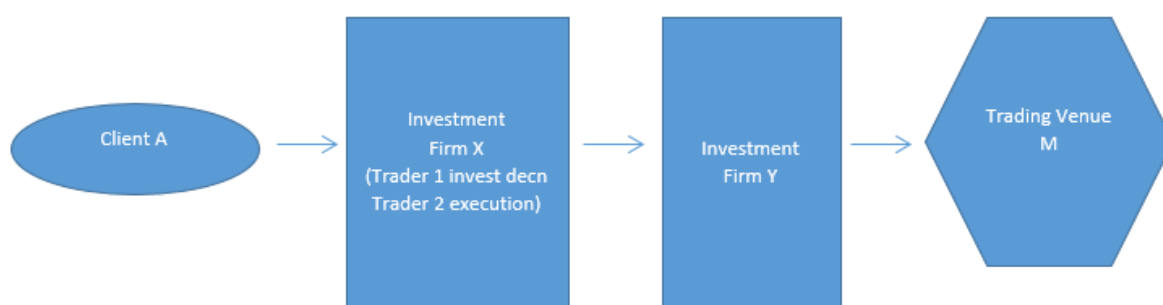
X befektetési vállalkozás jelentésében szerepeltetheti a végrehajtásnak az Y befektetési vállalkozás által neki visszaigazolt idejét.

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.

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

ea) 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.

eb) Egyszerű lánc. 65. példa: 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 kitettség 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 végrehajtj M kereskedési helyszínen az ügylethez az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli.



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

Y és X befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés	Értékközlés
		Y befektetési vállalkozás	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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</Ex ctgPty> ... <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> </AcctOwnr> </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> <TradPlcMchgid>1234</TradPlcMchgid> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </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 helyszíniig, 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 MNB kizárólag Y vállalkozás jelentését kapná meg.

ec) Hosszabb lánc. 66. példa: Az alábbiak az Ajánlás 37. pontjának 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>88888888888888888888 8888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111< /LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNPOQ RST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</Trnsmssn Ind> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpc ty> ... <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</Trnsmssnl nd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpc ty> ... <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>ABCDEFGHIJKLMNO PQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAA AAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</Trnsm ssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</Tradg Cpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt> Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> </pre>

<code><TradPlcMchglId>1234</TradPlcMchglId></code> <code>...</code> <code></Tx></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>	<code></New></code> <code></Tx></code>	<code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>
---	---	---

Az időpont a vállalkozásokra vonatkozó eltérő pontossági követelményeket figyelembe véve mindegyik jelentésben legyen azonos – lásd jelen Ajánlás 63. pontját 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 kitettség 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 kitettség 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.

ed) A MiFIR hatálya alá nem tartozó vállalkozást tartalmazó láncok:

eda) 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 GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG.

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> ...

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>GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG</LEI>
57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés	1. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx>
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	2. kereskedő {NATIONAL_ID}-ja	... <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.

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

			<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.

edc) 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.

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

fa) 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 részeként²⁹. 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.

- fb) A továbbító befektetési vállalkozás által közzendő 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 ügyletet érint, és ilyen esetben a továbbító befektetési vállalkozásnak meg kell adnia az egyes ügyleteknek allokálható mennyiséget.
- fc) 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.
- fd) 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).
- fe) 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 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.
- ff) 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

²⁹ A 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikk (2) bekezdésének a) pontja előírja, hogy a pénzügyi eszközt az "azonosító kóddal" kell azonosítani.

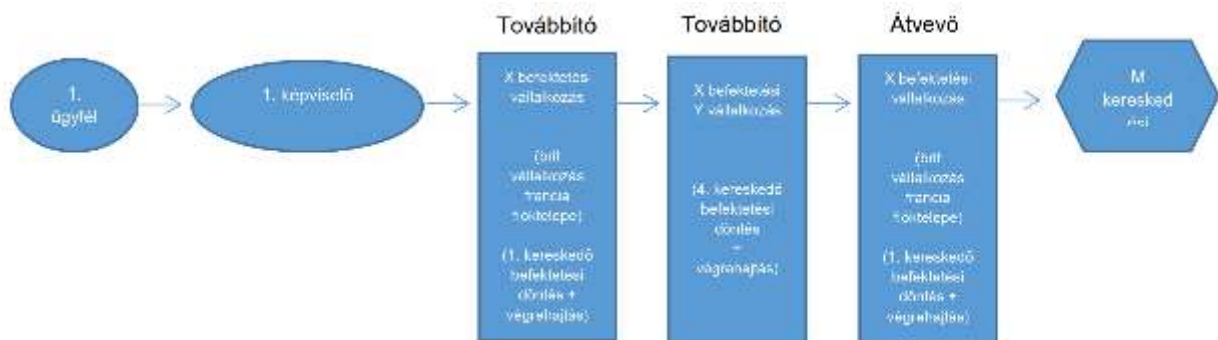
1. sz. ügyfél tulajdonában lévő 523 db árualapú származtatott terméket, és erre utasítást ad X befektetési vállalkozás francia fióktelepének. X vállalkozás brit központjának felügyelete alá tartozó 1. sz. kereskedő elfogadja a 1. képviselőtől a megbízást, és utasítást ad Y befektetési vállalkozásnak. 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 ügylet az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli.

Az árualapú származtatott termékek ISIN kódja XX0000000001.

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:

- A pénzügyi eszköz azonosító kódját: a pénzügyi eszköz ISIN kódja (XX0000000001),
- Azt a tényt, hogy a megbízás a pénzügyi eszköz eladására szól,
- A megbízás árfolyamát és mennyiségét (523 pénzügyi eszköz legalább 31 euró árfolyamon),
- Az eladó megjelölését: 1. sz. ügyfél nemzeti azonosítója,
- 1. sz. ügyfél adatait: vezetéknev és utónév, születési idő,
- A döntéshozó megjelölését és adatait: 1. képviselő nemzeti ügyfélazonosítója, vezetékneve, utóneve és születési ideje,
- 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),
- A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország: üresen marad,
- Az ügyféltől a megbízást átvevő X befektetési vállalkozás fióktelepe szerinti ország: FR

- Árualapú származtatott termék megjelölése: true (igaz),
- 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 első, megyedik és tizedik 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.

ffa) 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 vezetéknév		'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 (ügyfél oldal)
<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</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> ... <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMchglD>1234</TradPlcMchglD> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> </Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> </Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> </pre>

<pre> <Othr> <Id>FI1234567890A</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> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07- 01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <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).

ffb) Fogadó vállalkozás "saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végez/egyéb szerepben jár el":
71. példa: Ha a fogadó befektetési vállalkozás, azaz Z vállalkozás saját kitettség nélkül ügyletpárosítást végez, az alábbiak szerint tanácsos jelentenie:

N	Mező	1.	XML-beli ábrázolás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </New> </Tx> </pre>
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
7	A vevő azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	1. sz. ügyfél {NATIONAL_ID} -ja	
17	A fióktelep helye szerinti ország az eladó esetében	'FR'	
18	Eladó utóneve(i)	'JEAN'	
19	Eladó vezetéknéve(i)	'COCTEAU'	
20	Eladó – születési dátum	1962. 06. 04.	
21	Eladási döntéshozó kódja	1. sz. kereskedő {NATIONAL_ID} -ja	
22	Eladási döntéshozó – valamennyi utónév	'FABIO'	
23	Eladási döntéshozó – valamennyi vezetéknév	'LUCA'	
24	Eladási döntéshozó – születési dátum	1974. 10. 11.	
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'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} vállalkozás	<pre> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <Ordrtmsmssn> <TmsmssnInd>false</TmsmssnInd> <TmsmttgSellr>12345678901234567890</TmsmttgSellr> </Ordrtmsmssn> <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> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </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	Eszközaonosító 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.

ffc) 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 kitettség nélkül ügyletpárosítást végez", akkor A ügyfél ügyletjelentésében az árfolyam és az időpont – a felbonthatóságra vonatkozóan a 63. pontban 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) a 37. pont f) alpontban 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.

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

ga) 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.

gb) 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 ügylet az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli. X befektetési vállalkozás úgy dönt, nem adja tovább az adatokat Y befektetési vállalkozásnak.

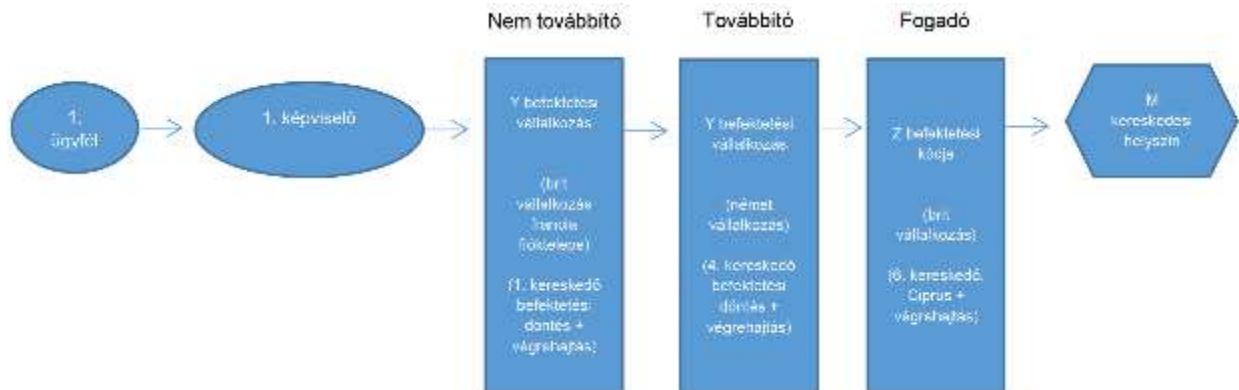
Y befektetési vállalkozás továbbítja a többi szükséges információval együtt ügyfele (azaz X befektetési vállalkozás) adatait Z befektetési vállalkozásnak, és megfelel a 2017/590/EU

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:

- A pénzügyi eszköz azonosító kódját: a pénzügyi eszköz ISIN kódja XX000000002,
- Azt a tényt, hogy a megbízás a pénzügyi eszköz eladására szól,
- A megbízás szerinti árat és mennyiséget,
- 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,
- A döntéshozó megjelölése és adatai: üresen maradnak,
- Short ügylet megjelölése: SELL (X befektetési vállalkozás nem rövidre ad el),
- Annak megjelölését, hogy a továbbító félnél személy vagy algoritmus a felelős a befektetési döntésért: üresen marad (mivel a befektetési döntést a vállalkozáson kívül hozzák),
- A befektetési döntést meghozó személyt felügyelő fióktelep országa: üresen marad (mivel a befektetési döntést a Y befektetési vállalkozáson kívül hozzák),
- 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),
- 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>8888888888888888 888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 1</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 8</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>8888888888888888 8888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890 </LEI> </Id> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>ABCDEFGHJKLMN OPQRST</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Pric> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>1234567890123456 7890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQR ST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE E</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr> </pre>

</Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMchglD>1234</TradPlcMchglD> </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>	<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>	<Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrmsmssn> <TrmsmssnInd>true</TrmsmssnInd> </OrdTrmsmssn> <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>
		</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 felügyletelt 6. sz. kereskedőt is³⁰.

gc) 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.

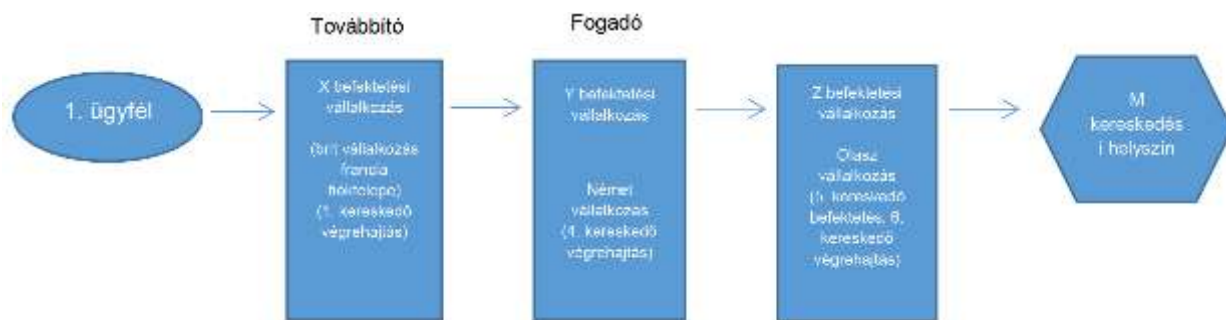
A megbízást ezután Z befektetési vállalkozás M kereskedési helyszín ajánlati könyvében 2018. július 1-én 13:40:23.4672-kor 32,50 euró árfolyamon teljesíti. A kereskedési helyszín az ügylet az '1234'-es ügyletazonosító kódot rendeli.

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.

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.

³⁰ Bár érdemes megjegyezni, hogy amennyiben az ügyfél hozná a döntést, a mezőben a 'NORE' érték szerepelne (lásd 23. pont).



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

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

<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>	... <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>	</DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>true</Trnsmssn Ind> <TrnsmmtgSellr>123456789012 34567890</TrnsmmtgSellr> </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> <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.

gd) 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 hajtja 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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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>ABCDEFGHJKLMN NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111 </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10- 28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct> <Qty> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMN NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA AAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> <TrnsmittgSellr>123456789012 34567890</TrnsmittgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10- 28T11:23:45.124Z</TradDt> </pre>	<pre> <Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMN NOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>1234567890123456789 0</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10- 28T11:23:45.124Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp ct> <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</TradgCp cty> <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>
---	--	---

38. Több ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján eljáró befektetési vállalkozás

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

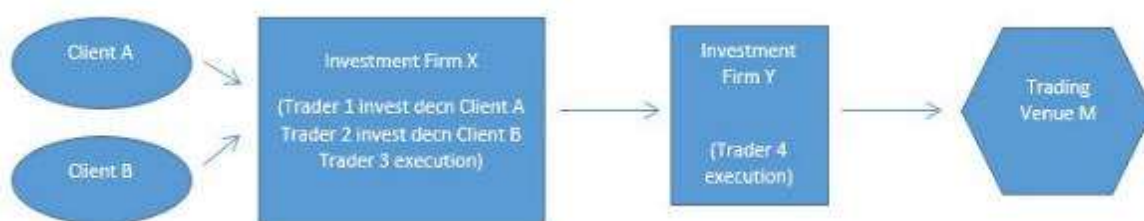
76. példa: X befektetési vállalkozás A és B ügyfél nevében diszkrecionális megbízás alapján jár el. 1. sz. kereskedő úgy dönt, A ügyfél nevében egy adott pénzügyi eszközből 400 egységet elad. 2. sz. kereskedő úgy dönt, ugyanebből a pénzügyi eszközből B ügyfél számára 200 egységet vesz. 3. sz. kereskedő 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 alapkezelő mögötti alapot, illetve ügyfelet, vagy adott esetben az alapkezelőt kellene vevőként, illetve 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.



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

- b) 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 a 76. példában bemutatott forgatókönyv 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 üzletazonosító kódja					'1234'	'6789'
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Z befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	Y befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	Y befekteté si vállalkoz ás jogalany- azonosít ó {LEI} kódja
7	A vevő azonosító kódja	'INTC'	'INTC'	A ügyfél jogalany- azonosító {LEI} kódja	B ügyfél jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befekteté si vállalkoz ás jogalany- azonosít ó {LEI} kódja
12	Vételi döntéshozó kódja			X befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	X befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja		
16	Az eladó azonosító kódja	Y befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	Y befekteté si vállalkozá s jogalany- azonosító {LEI} kódja	'INTC'	'INTC'	M keresked ési helyszính ez tartozó közpointi szerződő fél jogalany- azonosító {LEI} kódja	M keresked ési helyszính ez tartozó közpointi szerződő fél jogalany- azonosít ó {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
<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </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>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </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</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>1234567890123 4567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678 901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBB 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</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>

<TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<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>	<Amt Ccy="EUR">31.0416667</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>
---	--	---	--

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

<pre> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <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> <TradPlcMchgid>1234</TradPlcMchgid> </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> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <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> <TradPlcMchgid>6789</TradPlcMchgid> </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 ügyfelek felé irányuló mozgásokat is. Ha Y befektetési vállalkozás saját kitettség nélküli ügyletpárosítást végezne, azonos jelentéseket készítené azzal a kivétellel, hogy a jelentéseiben a kereskedési szerepre vonatkozó 29. mezőben a 'MTCH' értéket tüntetné fel.

- c) 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 fent 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'	'2018-06-24T14:25:30.126Z'	'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> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</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> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </pre>	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </pre>

<pre> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <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> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnI nd> </OrdrTrnsmssn> <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> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnI nd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T16:06:20Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCp cty> <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
<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> <TradPlcMtchgld>1234</TradPI cMtchgld> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn>	<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> <TradPlcMtchgld>6789</TradPI cMtchgld> </Tx> ...	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKL 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> <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 ügyfélallokációk mellett az Y befektetési vállalkozással kötött ügylet piaci oldalát kell jelentenie.

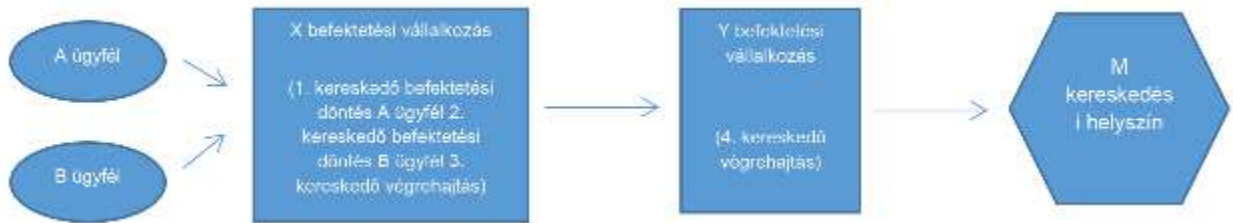
Mivel Y befektetési vállalkozás saját számlára kereskedik, X vállalkozásnak a teljesített összesített mennyiséget igazolja vissza, így X befektetési vállalkozás először az 'INTC' összesített számlára beérkező, összesített mennyiségre vonatkozó ügyletet jelenti, majd pedig az erről a számláról az ügyfelek 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 Ajánlás 37. pont g) alpontja.

- d) 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:

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

- 1. és 2. sz. ügyfélnek juttatott allokációkat
- Az eladók megjelölését: 1. sz. ügyfél nemzeti azonosítója és 2. sz. ügyfél nemzeti azonosítója
- 1. sz. ügyfél adatait: Vezeték- és utónév/nevek, Születési dátum
- 1. sz. ügyfél esetében a short ügylet megjelölését: SESH (1. sz. ügyfél rövidre ad el)
- A vállalkozáson belül 1. sz. ügyfél befektetési döntéséért felelős személy vagy algoritmus azonosítását szolgáló megjelölést: 1. kereskedő {NATIONAL_ID}
- 2. sz. ügyfél adatait: Vezeték- és utónév/nevek, Születési dátum
- 2. sz. ügyfél esetében a short ügylet megjelölését: SELL (2. sz. ügyfél nem rövidre ad el)
- 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
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM NOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM MNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr>

</Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> ... </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</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>	</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>
---	---	--

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</Trnsmss nInd> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06- 24T15:00:12Z</TradDt> </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> </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> </pre>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>700</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMchglD>1234</TradPlcMchglD> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>..</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn>	</Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgSellr>12345678901234567890</TrnsmtgSellr> </OrdTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </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> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch>
--	---	---

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

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

39. Közvetlen elektronikus hozzáférés (DEA)

- a) Ügyletjelentést (a B. változatban említett kivétellel) a DEA-szolgáltatónak és a DEA-ügyfélnek is be kell nyújtania, ha befektetési vállalkozásként működik.
- b) 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. A DEA-szolgáltató soha ne töltsen 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.
- c) 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 MNB az ügyletre vonatkozó összes információról értesül a DEA-szolgáltató ügyletjelentéséből.
- d) 1. forgatókönyv: a DEA-ügyfél saját számlára kereskedik mögöttes ügyfél nélkül:
 - da) 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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <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> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> <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.

e) 2. forgatókönyv: DEA-ügyfél egy ügyfél nevében jár el:

ea) 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> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> </Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMchgid>1234</TradPlcMchgid> </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> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdTrnsmssn> </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>

eb) B 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.

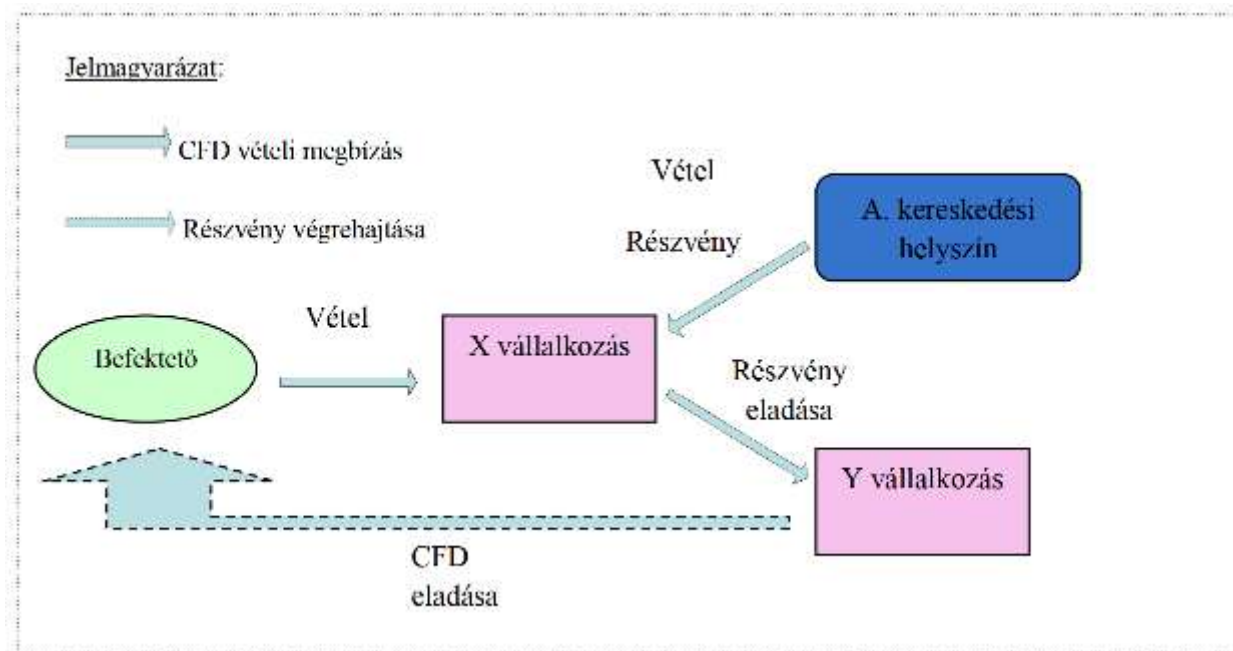
Y befektetési vállalkozás jelentésének tartalma:

N	Mező	Értékközlés Y befektetési vállalkozás	XML-beli ábrázolás
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'1234'	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmtgBuyr>12345678901234567890</TrnsmtgBuyr>
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
7	A vevő azonosító 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	
21	Eladási döntéshozó kódja		
25	Megbízástovábbítás megjelölése	'false' (hamis)	
26	A továbbító vállalkozás azonosító kódja a vevő vonatkozásában	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	

57	A vállalkozáson belüli befektetési döntés		</OrdrTmsmsn> <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgid>1234</TradPlcMtchgid> </Tx> <ExctgPrsn> <CInt>NORE</CInt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
58	A befektetési döntést hozó személyért felelős fióktelep helye szerinti ország		
59	Végrehajtás a vállalkozáson belül	'NORE'	
60	A végrehajtásért felelős személyt felügyelő fióktelep országa		

40. Pozíció fedezése különbözeti ügylettel (CFD)

- a) 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 ³⁹
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

<ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111 111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </FinInstrm> </New> </Tx>	<ExctgPty>123456789 01234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234 567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>	<ExctgPty>ABCDEF GHIJKLMN</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</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>	GHIJKLMN</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> ... <Othr> <Id>FR19620604JEAN #COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN OPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <FinInstrmGnlAttrbts> > <FullNm>VODAFONE CFD</FullNm> ... </FinInstrmGnlAttrbts> > ... </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
---	---	---	---

Y befektetési vállalkozás 2. jelentése az eszközről egyéb referenciaadatokat is tartalmaz, amelyek a fenti táblázatból kimaradtak. Az OTC CFD ügyletek bejelentését lásd az ajánlás IV. fejezetében.

41. A kereskedési helyszínek MiFIR 26. cikk (5) bekezdés szerinti ügyletjelentési kötelezettsége a saját rendszereiken keresztül teljesített ügyletekre vonatkozóan

- a) 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.
- b) A kereskedési helyszín 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 helyszín 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 helyszín akkor jár el helyesen, ha ellenőrzi, hogy a megadott nemzeti azonosító nem tartalmaz-e nyilvánvaló hibákat, illetve teljes-e.
- c) 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 'RRRRRRRRRRRRRRRRRRRR'. A kereskedési helyszín üzemeltetőjének a jogalany-azonosító kódja 'TVTVTVTVTVTVTVTVTV'. A kereskedési helyszín az ügyletjelentéshez az '55555555' kereskedési helyszín azonosító kódot és a '6868689' ügylet hivatkozási számot hozza létre.

Hogyan készítse el M kereskedési helyszín a jelentését?

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
2	Az ügylet referenciaszáma	'6868689'	<Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> ...
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'55555555'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
5	A 2014/65/EU irányelv hatálya alá tartozó befektetési vállalkozás	'false' (hamis)	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ...
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	... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchglId>55555555</TradPlcMtchglId> </Tx> ...
29	Kereskedési szerep	'DEAL'	... </New> </Tx>
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	

Az eszközre vonatkozó mezőket a IV. fejezetében 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.

d) Egyetlen ügyfél számára "saját kitettség 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 könyvén 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 'TVTVTVTVTVTVTVTVTVTVTV'. 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'	<pre> <Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>SSSSSSSSSSSSSSSSSSSSSS</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </Tx> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx> </pre>
3	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	'55555555'	
4	A végrehajtó szervezet azonosító kódja	R vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
5	A 2014/65/EU irányelv hatálya alá tartozó befektetési vállalkozás	'false' (hamis)	
6	A benyújtó szervezet azonosító kódja	M kereskedési helyszín üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	
7	A vevő azonosító kódja	S vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	M kereskedési helyszínhez tartozó központi szerződő fél jogalany-azonosító {LEI} kódja	
29	Kereskedési szerep	'AOTC'	
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	

Az eszközre vonatkozó mezőket a IV. fejezetében 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.

e) Több ügyfél megbízását összesítő vállalkozás:

ea) Ahol a vállalkozás több ügyfél megbízását összesíti adott kereskedési helyszínen, és "egyéb szerepben" jár el, vagy saját kitettség 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.

eb) 86. példa: A nem befektetési vállalkozásnak minősülő A vállalkozás M kereskedési helyszíni ajánlati könyvében keresztül három ügyfél, A, B és C ügyfél számára részvényeket vesz. R vállalkozás "egyéb szerepben" jár el. A kereskedési helyszíni üzemeltetőjének a jogalany-azonosító kódja 'TVTVTVTVTVTVTVTVTV'. A kereskedési helyszíni az '55555555' kereskedési helyszíni-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 helyszíni 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 helyszíni 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 helyszíni üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszíni üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszíni üzemeltetőjének jogalany-azonosító {LEI} kódja	M kereskedési helyszíni 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>RRRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR</ ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</i nvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTV TVTVTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111 11111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868690</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR</ ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</i nvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTV TVTVTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA AAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868691</TxId> > <ExctgPty>RRRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR R</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false </InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVT VTVTVTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBB BBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </AcctOwnr> </pre>	<pre> <Tx> <New> <TxId>6868692</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRR RRRRRRRRRRRRRR R</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false </InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVT VTVTVTVTVTVTVTV </SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCC CCCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <IntI>INTC</IntI> </Id> </pre>

... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... <TradPlcMtgld>55555555</TradPlcMtgld> ... </Tx> ... </New> </Tx>	... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx>	</Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx>
---	--	--	---

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.

42. Értékpapír-finanszírozási ügyletek

- a) Az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatszolgáltatási kötelezettség általános leírása az Ajánlás 17. pont b) alpontja tárgyi albekezdése tartalmazza (kivételek a 2017/590/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 2. cikk (5) bekezdés a) pontja alapján).
- b) 87. példa: CB központi bank (jogalany-azonosító kódja CBCBCBCBCBCBCBCBCB) 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	<Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CBCBCBCBCBCBCBCBCB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
7	A vevő azonosító kódja	CB központi bank jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
41	Eszközazonosító kód	{Államkötvény ISIN kódja}	

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>
----	---	---------------	---

III.4. IV. fejezet – Különböző eszköztípusok bejelentése

43. Alapelvek

- a) 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.
- b) 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.
- c) 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.

44. A kereskedési helyszínen kereskedett vagy az EÉPH listában szereplő pénzügyi eszközök azonosítása

- a) 88. példa: Egy befektetési vállalkozás pénzügyi eszközt szerez, amelynek ISIN kódja BE9999999999.

Ebben az esetben kizárólag az eszközazonosító kódot kell feltüntetni. Ha azonban az eszköz referenciaadataival kapcsolatos mezőkben is szerepelne adata, az MNB nem utasítja el az ügyletjelentést.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
41	Eszközazonosító kód	Instrumentum {ISIN} száma	<pre><Tx> <New> .. <FinInstrm> <Id>BE9999999999</Id></pre>
42	Eszköz teljes neve		
43	Eszközbesorolás		
44	Névleges pénznem 1		

45	Névleges pénznem 2		</FinInstrm>
46	Árszorzó		...
47	Alaptermék kódja		</New>
48	Alapul szolgáló index neve		</Tx>
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		

45. A kereskedési helyszínen nem kereskedett, illetve az EÉPH listájában nem elérhető pénzügyi eszközök azonosítása

- a) 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 ügylethez 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	<New> ... <Tx> ... <TradVn>XUSA</TradVn>
41	Eszközazonosító kód	{Határidős ISIN}	... </Tx>

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 EÉPH referenciaadatok listáján, akkor a 42-től 56-ig terjedő mezőket is ki kell tölteni.

b) 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.

A 89. példához képes az a különbség, hogy az eszközazonosító kódot (41. mező) ebben a példában nem kell feltüntetni.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
36	Helyszín	'XXXX'	<pre> <New> ... <Tx> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> ... </pre>
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'FUTURE ONTRACT JUN 2018'	
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'	

46. Konkrét pénzügyi eszközök bejelentése

a) 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 szegmensazonosító {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>
--	--	--	--

b) Kötvények és az értékpapírosított hitel egyéb formái:

ba) Nettó áron teljesülő ügylet forgatókönyve³¹. 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)³²,
- Elszámolási szabály: Ügylet napja után két munkanappal.

Változók (azaz a piaci feltételektől függő dinamikus jellemzők):

- Kereskedési nap 2014. június 5.,
- 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,

³¹ Nettó ár = bruttó ár – felhalmozott kamat

³² Az ACT/ACT az ICMA által a kötvények esetében ajánlott szabály.

- Felhalmozott kamat: 0,26506849

$$\left(\text{azaz } \frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2,25}{1} \times \frac{43}{365} \right)$$

Nominal coupon	Névleges kamat
Annual Coupon Frequency	Kamatfizetés éves gyakorisága
Accrued Number of Days	Ellelt 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:

Nettó összeg = (nettó ár x névleges érték) + (felhalmozott kamat x névleges érték).

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<code><Tx></code> <code><New></code> <code>...</code> <code><Tx></code> <code>...</code> <code><Qty></code> <code><NmnlVal</code> <code>Ccy="EUR">1000000</NmnlVal></code> <code></Qty></code> <code><Pric></code> <code><Pric></code> <code><Pctg>98</Pctg></code> <code></Pric></code> <code><NetAmt>982650,68</NetAmt></code> <code><TradVn>XOFF</TradVn></code> <code></Tx></code> <code><FinInstrm></code>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	
33	Árfolyam	'98'	
35	Nettó összeg	'982650,68'	
36	Helyszín	'XOFF'	
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	
			<code><Id>FR0011637586</Id></code> <code></FinInstrm></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>

- bb) 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

$$(\text{azaz } \frac{100}{1 + \frac{\text{Yield} \times \text{Days until maturity}}{100 \times \text{Period Basis}}} = \frac{100}{1 + \frac{-0.609 \times 154}{100 \times 360}})$$

Yield	Hozam
Days until maturity	Lejárat napokban
Period 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).

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal 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> </pre>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	
33	Árfolyam	'-0,609'	
34	Az árfolyam pénzneme		
35	Nettó összeg	1002611,97	
36	Helyszín	'XOFF'	
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	

bc) Forgatókönyv, 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,
- Lejárat 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

$$\left(\text{azaz } \frac{100}{\left(1 + \frac{\text{Yield}}{100}\right)^{\text{Time to maturity}}} = \frac{100}{\left(1 + \frac{1.06}{100}\right)^{\left(24 + \frac{272}{365}\right)}} \right)$$

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).

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<code><Tx></code> <code><New></code> <code>...</code> <code><Tx></code> <code>...</code> <code><Qty></code> <code><NmnlVal</code> <code>Ccy="EUR">1000000</NmnlVal></code> <code></Qty></code> <code><Pric></code> <code><Pric></code> <code><Yld>1.06</Yld></code> <code></Pric></code> <code><NetAmt>770343.52</NetAmt></code> <code><TradVn>XOFF</TradVn></code> <code></Tx></code> <code><FinInstrm></code> <code><Id>FR0010773200</Id></code>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	
33	Árfolyam	'1,06'	
34	Az árfolyam pénzneme		
35	Nettó összeg	770343,52	
36	Helyszín	'XOFF'	
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	
			<code></FinInstrm></code> <code>...</code> <code></New></code> <code></Tx></code>

bd) Átváltható kötvény

bda) 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)

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'1000000'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <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> </pre>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	
33	Árfolyam	'114,00'	
35	Nettó összeg	'1148406,59'	
36	Helyszín	'XOFF'	
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	

bdb) Forгатókönyv, 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	

c) Opciós szerződések:

ca) 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 részvénnel igen.

Az árszorító (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> <DivryTp>PHYS</DivryTp> </DerivInstrmAttrbts> <Othr> </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 szolgáltató 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'	

cb) 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 árszorító 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> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0001383545</ISIN> </Sngl> <Indx> <Nm> <RefRate> <Nm>FTSE100</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Othr> </Sngl> </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	Árszorító	'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'	

d) Különbözeti ügylet:

da) 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	Eszközaazonosító 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> <DivryTp>CASH</DivryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>

e) Árfolyamkülönbözet spekuláció:

ea) 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 részvénnel 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		</Qty>
42	Eszköz teljes neve	'ABC BET SPREAD'	<Pric>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<Pric>
46	Árszorzó	'100'	<MntryVal>
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló részvény {ISIN} kódja	<Amt Ccy="EUR">102.23</Amt>
55	Lejárat (expiry) időpontja		</MntryVal>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	</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-különbözet spekuláció esetében csak a szerződés kezdeti nyitó, illetve záró ügyletéről szükséges adatot szolgáltatni. A lejárat (expiry) időpontja üresen marad.

- eb) 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-különbözeti 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'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <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> </pre>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	
33	Árfolyam	9100	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'BOND FUTURE BET 27MAY15'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'1'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló határidős kontraktus {ISIN} kódja	
55	Lejárat (expiry) időpontja		
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

ec) Index alapú árfolyam-különbözet spekuláció. 102. példa: Egy befektető egy olyan részvényindex árfolyamára köt spekulatív különぼzeti 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 árszorzó 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'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">10</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>9340</BsisPts> </Pric> </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> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	
33	Árfolyam	'9340'	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'FTSE INDEX BET'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'1'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló index {ISIN} kódja	
48	Alapul szolgáló index neve	'FTSE100'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 10. 28.	<pre> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

ed) Árfolyamkülönbözet spekuláció szervezett kereskedési rendszerben kereskedett deviza határidős árfolyam-megállapodásra (FX Forward Rate Agreement: **FRA**). 103. példa: Egy befektető árfolyam-különbözeti spekulatív pozíciót vesz fe 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 különözeti spekuláció is.

Az árfolyam-különbözeti spekuláció teljesítése készpénzes.

N	Mező	Értékek	XML-beli ábrázolás
30	Mennyiség	'5'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">5</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">1.5355</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </pre>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	
33	Árfolyam	'1,5355'	
34	Az árfolyam pénzneme	GBP	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközaonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'GBP/USD FRA JUN16 BET'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorító	'100'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló	

		FRA (ISIN) kódja	<pre> </Tx> <FinInstrm> <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> </pre>
55	Lejárat (expiry) időpontja	2016. 06. 30.	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

ee) Árfolyamkülönbözet spekuláció szervezett kereskedési rendszerben kereskedett kamatopcióra. 104. példa: Egy befektető bázispontonként 2 GBP értéken árfolyamkülönbözeti 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'	<pre> <Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> </pre>
31	A mennyiség pénzneme	GBP	
33	Árfolyam	'0,71375'	
36	Helyszín	'XXXX'	

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.

f) Hitel-nemteljesítési csereügylet:

fa) 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> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<LEI>ABCDEF GHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>
30	Mennyiség	'1000000'	<Tx> <Qty> <NmnlVal
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty>
33	Árfolyam	'100'	<Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric>
36	Helyszín	'XXXX'	</Pric> <TradVn>XXXX</TradVn>
38	Előleg	'-33879'	<UpFntPmt> <Amt Ccy="EUR">33879</Amt> <Sgn>false</Sgn> </UpFntPmt>
39	Az előleg pénzneme	'EUR'	</Tx>
41	Eszközazonosító kód		<FinInstrm>
42	Eszköz teljes neve	'ALLIANZ SE SNR CDS'	<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>
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorító	'1'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló kötvény {ISIN} kódja	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2021. 06. 20.	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

			</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.

g) Csereügyletek:

ga) 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.

gb) 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 részvényt tartalmazó részvénytcsere 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.

gc) Előlegfizetés bármely csereügylet szerződésre vonatkozhat.

gd) Részvénytcsere ügylet (egy részvényt). 106. példa: X befektetési vállalkozás OTC forgalomban részvénytcsere ügyletet köt Y befektetési vállalkozással. Az alapul szolgáló részvényt 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 érték 1 000 000EUR, 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 részvénytcsere 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0.05</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <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> <Swpln> <Sngl> <ISIN>DE000BAY0017</ISIN> </Sngl> </Swpln> </Swp> </UndrlygInstrm> <Indx> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
30	Mennyiség	'1000000'	
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	
33	Árfolyam	'0,05'	
34	Az ár pénzneme		
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'BAYER EQS LIBOR3M+0.05% SEP 15'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	
46	Árszorzó	'1'	
47	Alaptermék kódja	'+"DE000BAY0017'	
48	Alapul szolgáló index neve	'-"LIBO'	
49	Alapul szolgáló index futamideje	'3'MNTH'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	2018. 12. 31.	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

			<pre> <Nm> <RefRate> <Indx>LIBO</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>
--	--	--	--

Figyelmet érdemel, hogy a 30. mezőben (Mennyiség) a bejelentett csereügylet szerződés névleges értékét kell feltüntetni. A 46. mezőben (Árszorzó) 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.

ge) EU-n kívüli kereskedési platformon forgó (két részvényt tartalmazó) részvénytársaság ügylet (az eszköz nem szerepel az EÉPH listáján). 107. példa: X befektetési vállalkozás részvénytársaság kontraktust vesz egy EU-n kívüli kereskedési platformon, amely ezért nem szerepel az EÉPH 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 részvénytársaság ügylet helyszínének kódja XUSA, és ez a helyszín központi szerződő féllel áll kapcsolatban, amelynek a jogalany-azonosító kódja CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

Az eszköz teljes neve szabadon kitölthető szöveges mező, amelyet a végrehajtó szervezet tölt ki: DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16.

A részvénytársaság 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	Árszorzó	'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> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> <TradVn>XUSA</TradVn> <UpFmntPmt> <Amt Ccy="EUR">1000</Amt> </UpFmntPmt> </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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</E xctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal> Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> <TradVn>XUSA</TradVn> <UpFmntPmt> <Amt Ccy="EUR">1000</Amt> </UpFmntPmt> </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> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <ISIN>ES0SI0000005</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>	<pre> <Swp> <Swpln> <Sngl> <Indx> <ISIN>DE0008469008</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>DAX 30</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Swpln> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <ISIN>ES0SI0000005</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <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.

gf) OTC (két részvényt tartalmazó) részvénytcsere ügylet (az eszköz nem szerepel az EÉPH listáján). 108. példa: X befektetési vállalkozás OTC részvénytcsere 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 részvénytcsere 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 részvénytcsere 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> ...
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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'	...
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	<Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty>
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	<Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg>
46	Árszorzó	'1'	</Pric>
47	Alaptermék kódja	'+'{alapul szolgáló Orange részvény ISIN kódja} '-'{alapul szolgáló 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> <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>
--	--	--	--

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> ... <ExctgPty>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	

			<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>
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 szolgáló Orange részvény ISIN kódja}'+{alapul szolgáló 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.

gg) OTC teljeshozam-csereügylet (az eszköz nem szerepel az EÉPH listáján). 109. példa: X befektetési vállalkozás az Austrian Traded Index (ATX) alaptermékre OTC teljeshozam-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 teljeshozam-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 lejáró 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	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	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> </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>
---	--

gh) OTC részvénykosár-csereügylet (az eszköz nem szerepel az EÉPH 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 képző 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 SEBPMC. 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	... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
16	Az eladó azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany- azonosító {LEI} kódja	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
30	Mennyiség	'21850000'	<Sellr> <AcctOwnr>
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	<Id> <LEI>12345678901234567890</LEI>
33	Árfolyam	'5'	</Id> </AcctOwnr>
34	Az árfolyam pénzneme		</Sellr>
36	Helyszín	'XXXX'	...
41	Észközazonosító kód		<Tx>
42	Észköz teljes neve	'KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018'	... <Qty> <NmnlVal
43	Észközbesorolás	{CFI kód}	Ccy="EUR">21850000</NmnlVal>
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	</Qty>
46	Árszorzó	'1'	

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> <UndrlyglInstrm> <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> </UndrlyglInstrm> <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.

gi) Két kosárra OTC csereügylet (az eszköz nem szerepel az EÉPH 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> </New> </pre>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
30	Mennyiség	'10000000'	
31	A mennyiség pénzneme	'EUR'	
33	Árfolyam	'0'	
34	Az árfolyam pénzneme		

36	Helyszín	'XXXX'	</AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">10000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <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> <Swpln> <Bskt> <ISIN>FI0009007884</ISIN> <ISIN>SE0000667925</ISIN> </Bskt> </Swpln> <SwpOut> <Bskt> <ISIN>FI0009005870</ISIN> <ISIN>FI0009014575</ISIN> </Bskt> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
44	Névleges pénznem 1	'EUR'	
46	Árszorzó	'1'	
47	Alaptermék kódja	"+"FI0009007884 "+" SE0000667925 "- "FI0009005870 "- "FI0009014575'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2018-07-15'	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

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.

g) Kereskedési helyszínen kötött hagyományos kamatcsere ügylet (az eszköz nem szerepel az EÉPH 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> ... <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="GBP">100000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XS0000000003</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
7	A vevő azonosító kódja	X befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
16	Az eladó azonosító kódja	Y befektetési vállalkozás jogalany-azonosító {LEI} kódja	
30	Mennyiség	'100000000'	
31	A mennyiség pénzneme	GBP	
33	Árfolyam	'0'	
34	Az árfolyam pénzneme		
36	Helyszín	M kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	
41	Eszközazonosító kód	Eszköz {ISIN} kódja	

A 33. mezőben feltüntetett árnak összhangban kell lennie az instrumentum referenciaadataiban szereplő fix árfolyam értékével.

h) Árualapú származtatott termékek:

ha) 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> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">0.95</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> </Tx> </pre>
30	Mennyiség	'100'	
33	Árfolyam	'0,95'	
34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközaonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'UPANDIN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORN FUTURES 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> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>FR0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <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.

hb) 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	<pre> <Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</Ex ctgPty> ... <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> </pre>
30	Mennyiség	'3000'	
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}	

hc) 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 piacon (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	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
30	Mennyiség	'5'	
33	Árfolyam	'7,90'	

34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</Ex ctgPty> ... <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> </pre>
36	Helyszín	A kereskedési helyszín szegmensazonosító {MIC} kódja	
41	Eszközazonosító kód	{A határidős kontraktus ISIN kódja}	

hd) 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 árszorító (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	<pre> <Tx> <New> ... </pre>
30	Mennyiség	'5'	
33	Árfolyam	'1,00'	

34	Az árfolyam pénzneme	'EUR'	<pre> <ExctgPty>12345678901234567890</Ex ctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">1.00</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <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> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
36	Helyszín	'XXXX'	
41	Eszközazonosító kód		
42	Eszköz teljes neve	'XXX CALL OPTION'	
43	Eszközbesorolás	{CFI kód}	
46	Árszorzó	'10'	
47	Alaptermék kódja	Alapul szolgáló határidős kontraktus {ISIN} kódja	
50	Opció típusa	'CALL'	
51	Kötési árfolyam	'8,00'	
52	Kötési árfolyam pénzneme	'EUR'	
53	Az opció gyakorlásának típusa	'EURO'	
55	Lejárat (expiry) időpontja	'2018-12-31'	
56	Teljesítés típusa	'CASH'	

A vételi opció alapterméke a határidős kibocsátási egység kontraktus, ezért a 47. mezőben ennek a határidős kontraktusnak az azonosítója áll.

i) Összetett ügyletek:

- ia) 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.
- ib) 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
<pre><Tx> <New> <TxId>89127</TxId></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>89128</TxId></pre>	<pre><Tx> <New> <TxId>89129</TxId></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>	<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>
---	---	---

ic) 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 ügyletnek 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>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</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>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</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>DE00000000001</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx> </pre>
--	--

IV. A megbízások nyilvántartására vonatkozó ajánlások

IV.1. I. fejezet – Általános elvek

47. A megbízások nyilvántartási követelményeinek hatálya

- a) A MiFIR 25. cikk (2) bekezdése alapján a megbízások nyilvántartására vonatkozó követelmények a kereskedési helyszínek működtetőire terjednek ki "a rendszereiken keresztül meghirdetett összes megbízást" illetően.
- b) 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.

48. Kereskedési helyszín tagjai vagy résztvevői

- a) A MiFIR számtalan rendelkezésében hivatkozik a kereskedési helyszín "tagjára vagy résztvevőjére". A "kereskedési helyszín" fogalmát a Bszt. 4. § 34a. pontja akként határozza meg, hogy az magában foglalja a szabályozott piacot, a multilaterális kereskedési rendszert vagy szervezett kereskedési rendszert. Ugyanakkor pontosítani szükséges, hogy a Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a és a MiFIR 25. cikk (2) bekezdése értelmezésében mit jelent a kereskedési helyszín "tagja vagy résztvevője".
- b) 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 igénybevételeire jogosult személyekre tagokként vagy résztvevőkként lehet hivatkozni. E két kifejezés egymással felcserélhető...".
- c) Ugyanakkor a szervezett kereskedési rendszerek (OTF) esetében egy másik módszer érvényesül annak fényében, hogy az MTF-ek és a szabályozott piacok működtetőihez képest az ETF-ek működtetőire az ügyfelekkel való érintkezésben a MiFID II alapján további kötelezettségek hárulnak. Például a Bszt. 146. § (2) bekezdése kimondja, hogy az MTF-ek és az ETF-ek rendelkezzenek "legalább három, ténylegesen aktív taggal vagy felhasználóval". Továbbá a MiFID II 20. cikke tiltja, hogy az „ügyfelek” megbízásait az ETF saját eszközeinek terhére hajtsa végre. Mindkét esetben úgy tűnik, hogy amikor az ETF-ről van szó, a „felhasználó” és az „ügyfél” kifejezés egymással felcserélhető, akárcsak a „tag” vagy a „résztvevő” kifejezések.
- d) Tekintve, hogy az ETF-ekre kiterjed a piaci visszaélésekről szóló rendelet hatálya, és mivel a a Bszt., Tpt. és 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.

49. Ügyfél-azonosító kód (3. mező)

- a) 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 helyszín 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 helyszín tagjának vagy résztvevőjének az ügyfele.



End client	Végső ügyfél
Investment Firm 1	1. sz. befektetési vállalkozás
Member of Participant of Trading Venue	Kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője
Trading Venue	Kereskedési helyszín

- b) 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.
- c) Abban az esetben, ha az ügyfél-azonosító kód beszerzése nem történik meg akkor, amikor a megbízást a kereskedési helyszín működtetőjének benyújtják, a működtető a lehető legrövidebb időn belül, de legkésőbb az ajánlat beadását követő munkanap zárásáig szerezze azt be.
- d) Az ügyfelek esetében a kereskedési helyszín kell, hogy ellenőrizze, hogy a megadott azonosító kód nem tartalmaz nyilvánvaló hibákat vagy hiányosságokat.
- e) 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 helyszín tagjához vagy résztvevőjéhez továbbítanak, de a kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője több ügyfél ajánlatát összesíti, akkor a kereskedési helyszín működtetője a 3. mezőben lehetőleg az alapértelmezett "AGGR" hivatkozást tüntesse fel.

- f) 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 helyszín működtetője a 3. mezőben az ilyen megbízás esetén lehetőleg a "PNAL" alapértelmezett hivatkozást tüntesse fel. A kereskedési helyszín érintett működtetője később nem köteles az ügyfél-azonosító kódját megszerezni, amikor már a megbízásokat egyes ügyfeleknek allokálják.

50. Továbbító bróker (6. mező)

- a) A továbbító bróker tevékenysége nem azonos a Bszt. 4. § 38a. pontjában 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.
- b) 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 (értelmszerűen)	
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	

51. 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.

52. Érvényességi időszak dátuma és időpontja (12. mező)

- a) 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).
- b) 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.

53. 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.

54. A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja (TVTIC) (48. mező)

- a) 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.
- b) 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 bejelentsse az adott TVTIC kódot.

55. Sorszám (15. mező)

- a) 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.
- b) Egyes kereskedési helyszíneken több megbízáspárosító rendszer is működhet a rendszer terhelésének kiegyenlítése érdekében. Ilyen esetben a sorszámnak minden egyes eseményt illetően egyedinek, és az adott megbízáspárosító rendszeren belül következetesnek kell lennie.
- c) Példával az alábbi eseteket szemléltetjük:
- Olyan hibás használat, ahol a sorszám csak egyetlen ajánlati könyvre nézve egyedi
 - Olyan hibás használat, ahol a sorszám láthatóan megbízásonként egyedi
 - A sorszám helyes használata.
- ca) 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 MNB képtelen lenne összevonni a több ajánlati könyvben előforduló, de ugyanazon a megbízáspárosító 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

cb) 121. példa: Olyan hibás használat, ahol a sorszám láthatóan megbízásonként egyedi: Itt a sorszám egyértelműen megbízásonként és nem az egész megbízáspárosító 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.

cc) 122. példa: A sorszám helyes használata: Ebben a példában azt feltételezzük, hogy minden esemény ugyanabban az ajánlati könyvben történik, és a kereskedési helyszínen egy megbízáspárosító rendszer működik.

Új ajánlat, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges 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 helyszín 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.

56. Érvényességi időszak (10. mező)

a) 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

b) 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 Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a 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 Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a szerint jelölve) (2. esemény).

ba) 1. esemény: A megbízás benyújtása végrehajtásra^{33 34}:

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 ³⁴
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		

³³ Illetve bármely egyéb a kereskedési kezdete és/vagy a nyitó kereskedési szakasz előtti időbélyegző beszúrható.

³⁴ Amikor a megbízást a kereskedési helyszínre benyújtják, az a GADV érvényességi időszak miatt inaktív státuszú.

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

bb) 2. esemény: A megbízás aktívvá válik^{35 36}:

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

57. Likviditásnyújtási tevékenység (8. mező)

- a) A kereskedési helyszínek tagjainak vagy résztvevőinek likviditásnyújtási tevékenysége általában az alábbi három forgatókönyv közül az egyiknek a megvalósulása során fordul elő:
- aa) a tag vagy a résztvevő egy árjegyzői stratégia megvalósítása érdekében algoritmikus kereskedést végez, és emiatt a a Bszt. 26/C. § (1) bekezdés b) pontja, valamint a Tpt. 316/A. § (2) bekezdés a) pontja alapján szerződést köt valamelyik kereskedési helyszínnel;
 - ab) a (a Bszt. 26/C. § (2) bekezdésben meghatározott árjegyzőnek nem minősülő) likviditásnyújtási tevékenységet végző tag vagy résztvevő saját számlára kereskedik a kibocsátóval vagy a kereskedési helyszínnel kötött megállapodás alapján;
 - ac) a likviditásnyújtási tevékenységet végző tag vagy résztvevő ügyfelek nevében hajt végre megbízásokat a kibocsátóval vagy a kereskedési helyszínnel kötött megállapodás alapján.
- b) Az fenti aa) - ac) pontokban felsorolt likviditásnyújtási tevékenységeknek meg kell jelennie a kereskedési helyszín nyilvántartásában, és ehhez az ügyfelek nevében végrehajtott

³⁵ Illetve bármely egyéb a kereskedési kezdete és/vagy a nyitó kereskedési szakasz előtti időbélyegző beszúrható.

³⁶ A megbízás aktívvá válása státuszváltozást jelent a piaci működés miatt.

megbízások esetén megfelelően ki kell tölteni a 7. mezőt (kereskedési szerep), a 8.mezőt (likviditásnyújtás), valamint a 3. mezőt (Ügyfél- azonosító kód).

c) 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)

IV.2. II. fejezet – Forgatókönyvek

58. Magyarázat

- a) Az adott forgatókönyvben jelzett ellenkező értelmű rendelkezés hiányában az alábbi háttérinformáció a II. fejezetben 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.
- b) 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 valamilyik mező üresen marad, akkor az információt úgy tanácsos szolgáltatni, hogy az MNB meg tudja állapítani, hogy az adott mező üres.

59. Központi limitáras ajánlati könyv

- a) Új/Törlés/Megbízás módosítása (21. mező):

aa) Új megbízás fogadása:

aaa) Az első bejelentendő esemény az "Új megbízás" még akkor is, ha a megbízás az ajánlati könyvbe kerülve azonnal teljesül.

aab) 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 helyszín 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	LMT0
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

ab) 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 helyszín 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	LMT0
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

ac) 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	LMT0
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

ad) 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

ae) Megbízás törlése: 130. példa: X befektetési vállalkozás M kereskedési helyszínén 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 helyszín megbízáspárosító 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

37

b) Kiegészítő limitár (25. mező):

131. példa: M kereskedési helyszín 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 helyszín 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 helyszínre vételi megbízás érkezik 100 EUR maximális vételáron, és a megbízás tartalmaz egy kiegészítő minimális vételárat is 95 eurón.

³⁷ Ez a mező az 51. pont 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.

c) 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 előtt 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).

ca) 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	

cb) 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	Nincs változás.
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	

cc) 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	

d) Peg (vagy kötött) megbízások³⁸:

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 árfolyamhoz³⁹,
- Az ajánlati könyv státusza⁴⁰ 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

da) 1. esemény: a megbízás bekerül M kereskedési helyszín ajánlati könyvébe:

M kereskedési helyszín ajánlati könyvének státusza a megbízás bevitele 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

³⁸ 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.

³⁹ Ez a várakozás minden olyan kereskedési helyszínen technikai szükségszerűség, amely kötött típusú megbízást befogad (ezt az információt nem szokták nyilvánosságra hozni).

⁴⁰ 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 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

db) 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

dc) 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	Változatlan	

e) 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:

- változat: (limitár nélküli) piaci megbízássá, illetve;
- változat: (101,00 EUR limitáron) limitáras megbízássá.

A megbízás érvényességi időszaka alapján visszavonásig érvényes, azaz aktiválódásáig, illetve törléséig az ajánlati könyvben marad.

ea) 1. esemény: a megbízás bekerül 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	2018-03-07T10:05:32.652785Z	
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 bevitel 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	

eb) 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	A. változat szerint [üresen marad] valamint B. változat 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.

f) Továbbított megbízás:

fa) 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 minkét 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 státusza⁴¹ mielőtt a megbízás beérkezik M kereskedési helyszínre:

Az ajánlati könyv státusza M kereskedési helyszínen, ahova a megbízás eredetileg beérkezik

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

Az ajánlati könyv státusza N kereskedési helyszínen, ahova a megbízást továbbítják

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

fb) 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.

⁴¹ 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_TVN_ONLY	Az M kereskedési helyszínről meghatározása szerint (maximum 50 karakter hosszú) alfanumerikus szöveg

fc) 2. esemény: a megbízást N kereskedési helyszínrre továbbítják:

fca) 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 helyszínrre továbbítja a kereskedő által adott utasítás alapján. Ezért a megbízás kikerül M kereskedési helyszínr ajánlati könyvéből. Ha azonban a megbízás N kereskedési helyszínrre sem teljesülhet, a lekötetlen mennyiség a kereskedő eredeti utasításai szerint visszatér M kereskedési helyszínr 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 helyszínrre továbbítják
36	Kezdeti mennyiség	150	Nincs változás
37	Fennmaradó mennyiség, ideértve a nem látható mennyiséget	150	A mezőben a másik kereskedési helyszínrre továbbított mennyiség áll
38	Megjelenített mennyiség	0	A megbízásnak a másik kereskedési helyszínrre továbbított mennyisége ez idő alatt M kereskedési helyszínrre nem látható.

fc) 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 helyszínrre 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 helyszínrre TOVÁBBÍJTÁK
36	Kezdeti mennyiség	150	Nincs változás
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 helyszínrre továbbított mennyisége ez idő alatt M kereskedési helyszínen nem látható
39	Kereskedett mennyiség		A 25 db részvény vétele egy korábbi eseményben rögzül

fcc) 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	

fd) 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:

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			
48	A kereskedési helyszín ügyletazonosító kódja	DEF54321	

fda) 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 helyszín nyilvántartásaiban az eredeti megbízáshoz kapcsolva kell feltüntetni.

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	2018-03-07T10:05:32.662788Z	
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	Nincs változás
36	Kezdeti mennyiség	150	Nincs változás
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 helyszín ügyletazonosító kódja		Ezt a mezőt nem szabad üresen hagyni, mert az ügyletet nem M kereskedési helyszínen hajtotta végre.

fdb) B. változat szerint: Az N kereskedési helyszínrre történő továbbítás előtt a megbízást M kereskedési helyszínr részlegesen (25 db részvény erejéig) végrehajtja. Ezért az N kereskedési helyszínr továbbított megbízás csak 125 db részvényre vonatkozik. Az N kereskedési helyszínrre beérkező megbízás (100 db részvény vételével) részlegesen teljesül.

Az N kereskedési helyszínrn létrejött ügyletet M kereskedési helyszínr 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 helyszín hajtotta végre.

fe) 4. esemény: a továbbított megbízás státusza ismét aktívra vált M kereskedési helyszíni 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 helyszíni ajánlati könyvébe továbbították. A prioritási időbélyegző azt az időpontot mutatja, amikor a megbízás visszaérkezik M kereskedési helyszíni 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	Nincs változás
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók			
33	A megbízás státusza	ACTI	Ebben a változatban a megbízás státusza M kereskedési helyszíni ajánlati könyvében aktívra vált.
36	Kezdeti mennyiség	150	Nincs változás
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	

g) 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 XXABCDEFGHJI.

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: 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.

ga) 1. esemény: X befektetési vállalkozás megbízása beérkezik az ajánlati könyvbe:

Az ajánlati könyv státusza⁴² 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

⁴² 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 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:

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	Stratégiahoz kapcsolt megbízás azonosítása		Üres, mert még nincs végrehajtva.

gb) 2. esemény: Y befektetési vállalkozás megbízása beérkezik az ajánlati könyvbe:

Az ajánlati könyv státusza⁴³ 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	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST	
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

⁴³ 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 bevitel 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.

gc) 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

Az ajánlati könyv státusza⁴⁴ az implikált 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

A 225-ös július-augusztusi FCAL ajánlati könyve esetében: M kereskedési helyszínen 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 helyszínen és nem egy tagja/résztvevő hozott létre.

N	Mező	A releváns megbízási adatoknak az illetékes hatóság kérésére történő rendelkezésre bocsátásához használandó szabványok és formátumok	Leírás (értelmezés szerint)
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 bevitel dátumával és időpontjával azonos
15	Sorszám	3758947	
F. szakasz – A megbízás azonosítása			
17	Az ajánlati könyv kódja	256786	M kereskedési helyszínen ajánlati könyvének kódja.
18	A pénzügyi eszköz azonosító kódja	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Mivel a stratégiák nem pénzügyi eszközök, nincs ISIN számuk, így a stratégia részét képező ISIN-ek lettek megadva.

⁴⁴ Az iránymutatások értelmezésében minden egyes árszínhez 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	Stratégiahoz kapcsolt megbízás azonosítása		Üres, mert még nincs végrehajtva.

gd) 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 július-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 bevitel 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	Stratégiahoz kapcsolt megbízás azonosítása		Üres, mert még nincs végrehajtva.

ge) 5. esemény: Végrehajtás a naptári különbözeti ügyletek ajánlati könyvében és sima szerződésekre vonatkozó megbízások változásai:

Az ajánlati könyv státusza⁴⁵ a végrehajtás időpontjában:

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:

⁴⁵ A narancsszínnel kiemelt megbízások végrehajtása történik meg, é emiatt frissülnek a késsel kiemelt megbízások, valamint a lilával jelölt megbízás teljes végrehajtása is.

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, XXABCDEFGHIJ	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	Stratégiahoz 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/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	2018-03-07T10:09:56.684251Z	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, XXABCDEFGHJIJ	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	Stratégiahoz 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 (értelmszerűen)
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	Stratégiahoz kapcsolt megbízás azonosítása	Xj26K983c	Kitöltését a végrehajtás részét képző vonatkozó sima megbízásoknak a végrehajtás részét képző 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	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST	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	Stratégiahoz 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 különbségi ügyletek ajánlati könyvében szerepel.

h) Stratégiai megbízások besorolása (46. mező): Kiimplikáló funkció:

Ugyanaz a módszertan alkalmazandó, mint a beimplikált megbízások esetén.

i) Prioritás megváltoztatása:

ia) 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 részvényt 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.

iaa) 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

iab) 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

iac) 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

ib) 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 részvénnel 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.

iba) 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

ibb) 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

ibc) 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

ic) 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

j) 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 sorukon szerepelnek. A kereskedési fázist tartalmazó sort minden változása esetén kezelni kell. Az indikatív aukciós ár és az indikatív aukciós volumen a saját sorukon együtt láthatók akkor és úgy, amikor és ahogy változnak.

ja) 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 részvényértéket 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:

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	20068	
F. szakasz – A megbízási azonosító			
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.

jb) 2. esemény: Megbízási bevitele 100 db részvényre: Az adatszolgáltatás 3. sora tartalmazza a bevitt új ajánlatot az alábbiak szerint (a táblázatban nemszerepel 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	2018-06-27T06:55:21.528754Z	

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.

jc) 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):

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	2018-06-27T06:57:46.255897Z	
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 bevitele, 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	
----	---------------------------	----	--

jd) 4. esemény: Új megbízás bevitele 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 (értelmeszerűen)
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 bevitel 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 (értelmeszerűen)
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 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	Az 1 GBP aukciós ár változatlan marad.
51	Indikatív aukciós volumen	75	A volumen 75 db részvény.

je) 5. esemény: Az aukciós átfedés megszűnik, és megkezdődik a folyamatos kereskedelem: Az adatszolgáltatás 8. sora azt mutatja, hogy a 100 db részvényre szóló vételi megbízás az 50 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 (értelmeszerűen)
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 bevitel 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 részvénnel 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 bevitel időpontjával azonos.
15	Sorszám	20256	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	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 megbízás az 25 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 (értelmszerűen)
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 (értelmezés szerint)
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 megbízás 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 megbízás azonosító kódja		Üresen marad, hiszen a kereskedési fázis változik.
K. szakasz – Kereskedési fázisok, indikativ aukciós ár és volumen			
49	Kereskedési fázisok	Folyamatos kereskedés	Megkezdődött a folyamatos kereskedés.

60. Jegyzéskérési rendszerek

- a) 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.
- b) A jegyzéskérési rendszernek egyedi jellegzetességei vannak. Az egyes 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 jegyzéskérést?
 - 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?
- c) Hogyan tartjuk nyilván a konkrét üzleti partnereknek megküldött jegyzéskérést?
- ca) A jegyzéskérést új megbízásként a megbízás-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).

- cb) 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:⁴⁶

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 ⁴⁶		
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók					
32	Vétel / eladás mutató		SELL		
36	Kezdeti mennyiség		1000		
47	Továbbítási stratégia		ABCDEFGHIJKLMNOPQRST		

⁴⁶ 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.

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 az Ajánlás 59. pontjában.

- d) Hogyan tartuk 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 perccig 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 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	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	Megbízáskorlátozás	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 ^{3U}
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMT0
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	8,750
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	1000

- e) Hogyan tartuk 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 szolt). 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

20	A megbízás azonosító kódja	78901223GHI
G. szakasz – A megbízást befolyásoló események		
21	Új megbízás, módosítás, törlés, visszautasítás, részleges vagy teljes végrehajtás	RFQR ⁴⁷
H. szakasz – Megbízás típusa		
22	A megbízás típusa	Limit
23	A megbízástípus besorolása	LMT0
I. szakasz – Árak		
24	Limitár	8,750
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	BUYI
36	Kezdeti mennyiség	600

47

- f) Hogyan tartuk 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		

⁴⁷ Ezt a kódot a vonatkozó 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.

28	Ügyleti ár	8,750
J. szakasz – A megbízásra vonatkozó instrukciók		
32	Vétel / eladás mutató	SELL
39	Kereskedett mennyiség	1000
47	Továbbítási stratégia	ABCDEFGHGIJKLMNOPQRST
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	ABCDEFGHGIJKLMNOPQRST
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

V. Az órák összehangolására vonatkozó ajánlások

61. A Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a és a kapcsolódó szabályozástechnikai standardok szerint a kereskedési helyszínek, valamint ezek tagjai 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.

62. Jelentendő események

- a) A Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a alapján a kereskedési helyszínek és tagjaik kötelesek összehangolni a jelentendő események dátumának és idejének rögzítésére alkalmazott üzleti óráikat. Az EÉPH szerint az 50. cikk értelmezése érdekében fontos a "jelentendő eseményeket" példákon keresztül bemutatni.
- b) Az EÉPH szerint a "jelentendő esemény" az alábbi kötelezettségekre terjed ki:
- A MiFIR 7., 10. és 11. cikke szerinti átláthatósági követelményekhez kapcsolódó 2017/587. számú felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet I. mellékletének 3. táblázata, valamint a 2017/583. számú felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet II. melléklet 1b) táblázata alapján kerül sor a kereskedés idejének és a közzététel idejének nyilvánosságra hozatalára;
 - 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 Bszt. 55. § (1) bekezdése alapján fennálló, és a 2017/565/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletének 74. cikke által előírt nyilvántartási kötelezettségekre);
 - A 2017/589/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 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 Bszt. 26/B. § (6) bekezdése ír elő.
 - A 2017/580/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben a 9., 12. és 13. mezőben meghatározott megbízásokat érintő eseményekkel kapcsolatos időpont nyilvántartására, amelyet a MiFIR 25. cikk (2) bekezdése ír elő.

63. Az időbélyegző felbontása

- a) A Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a a jelentendő események széles körére vonatkozik (62. pont). 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.
- b) Az MNB felhívja a figyelmet arra, hogy a Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a csak a kereskedési helyszínen végbement jelentendő eseményekre vonatkozik. Nem vonatkozik például az OTC ügyletekre.
- c) Egy kereskedési helyszín tagja vagy résztvevője nem köteles az időbélyegzőre nézve ugyanazokat a követelményeket teljesíteni, amelyek arra a kereskedési helyszínrre érvényesek, amelynek a tagja vagy résztvevője. A tag vagy a résztvevő az időbélyegzőt kizárólag a Bszt. 152. § (2) bekezdése, a 154/G. § (3) bekezdése, valamint a Tpt. 316/C. §-a alapján a vállalkozása kereskedési tevékenységére vonatkozó követelmények szerint alkalmazza.
- d) Abban az esetben, amikor egy ügylet végrehajtásában befektetési vállalkozások láncolata vesz részt (s eközben az eredeti megbízást a láncban az egyik befektetési vállalkozás a másikkal 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.
- e) A MiFIR 26. cikke és a Bszt. 55. § (1) bekezdése - Ügyletjelentés, az ügyletek nyilvántartása és a megbízások feldolgozása:

ea) 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 ajánlás 15. pontja az "Ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen" cím alatt ismerteti. Ehhez hasonlóan Bszt. 55. § (1) bekezdése alapján a befektetési vállalkozások ugyanezt a 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendeletben meghatározott követelményt alkalmazzák a kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek és a kereskedési helyszínrre benyújtott megbízások időpontjának rögzítésére.

eb) 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 Bszt. 55. § (1) bekezdés alapján a 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".

ec) Példák: az alábbiakban példákat közlünk arról, hogyan kell a megbízások adatait és az ügyletjelentéseket időbélyegzővel ellátni. Figyelmet érdemel, hogy mivel az időpontok UTC+1 szerinti, 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.

ed) 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 Bszt. 4. § 49c. pontjában 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 a Bszt. 4. § 49c. pontjában meghatározott körbe.

M kereskedési helyszínen az elektronikus megbízáspárosítási rendszerben az átjárók közötti késleltetés ideje 350 mikroszekundum.

ee) MiFIR 25. cikk és a Bszt. 26/B. § (6) bekezdés – 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 a2018-06-20T11:11:38.478598Z 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.

ef) MiFIR 26. cikk ügyletjelentés - Ha X és Y befektetési vállalkozás megbízásait M kereskedési helyszínen hajtaná végre, akkor mind X, mind Y vállalkozásnak ügyletjelentési kötelezettsége keletkezik.

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.

eg) 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.

eh) 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 megbízaspárosító 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 Bszt. 4. § 49c. pontjában meghatározott körbe.

ei) MiFIR 25. cikk és Bszt. 26/B. § (6) bekezdés – megbízások adatainak nyilvántartása: Az A

kereskedési helyszín 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.

ej) MiFIR 26. cikk – ügyletjelentés:

eja) 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.

ejb) Olyan lánc esetében, ahol a végső ügylet végrehajtása kereskedési helyszínen történik, kizárólag a kereskedési helyszín 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.

64. A maximális megengedett eltérés mértékére vonatkozó követelmények teljesítése

a) 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.

- b) Elvárt 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.
- c) 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 időforrásokról⁴⁸, amelyekre szigorúbb pontossági követelmények vonatkoznak.
- d) A 2017/574/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkének értelmezésében a műholdas rendszert használókra 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). Ebben nem tanácsos belefoglalni a GPS műholdas rendszert és azt sem, hogy a műholdak visszavezethetők-e az UTC-re.
- e) 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 a Nemzetközi Távközlési Egyesület TF. 460-6-os rádiókommunikációs (ITU-R) ajánlásával összhangban tanácsos megtenni. Az ajánlás leszögezi, hogy a pozitív

⁴⁸ 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>

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.

f) 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

g) A kereskedési helyszínen közvetlen tagsággal vagy részvétellel nem rendelkező befektetési vállalkozásokra vonatkozó joghatály:

A Bszt. 152. § (2) bekezdés, a 154/G. § (3) bekezdés, valamint a Tpt. 316/C. § hatálya kizárólag a kereskedési helyszínekre és azok tagjaira, résztvevőire terjed ki. A MiFIR-re vonatkozó 2017/589/EU felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet és a Bszt. 55. § (1) bekezdés 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.

h) 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 EÉPH 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 megbízáspárosító rendszerre értendő, ezért nagy valószínűséggel az alkalmazás által létrehozott időbélyegzőt fogják használni.

i) Az átjárók közötti késleltetés:

ia) A kereskedési helyszínek a különböző percentilisekhez több átjárók közötti késleltetési időt is felsorolhatnak. Az EÉPH szerint az órák összehangolása szempontjából a kereskedési helyszínek akkor járnak el helyesen, ha a 99. percentilisre vonatkozó átjárók közötti késleltetési időt használják.

ib) A kereskedési helyszín a 13. cikk c) pontja alapján köteles az átjárók közötti késleltetés időtartamát valós időben figyelemmel kísérni (ESMA/2015/1464)⁴⁹. Ha az átjárók közötti

⁴⁹ 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

késleltetés időtartama 1 milliszekundumnál hosszabb időről azzal egyenlő vagy annál rövidebb időtartamra javul, akkor megváltoznak a kereskedési helyszínnak az 50. cikk alapján fennálló időfelbontásra és maximális megengedett eltérésre vonatkozó kötelezettségei. Ilyen forgatókönyv kialakulása egy új megbízáspárosító rendszerre történő átállás, illetve a helyszíni létező infrastruktúrájának technológiai javítása után a legvalószínűbb, ezért az ilyen munkák tervezésénél érdemes az időbélyegzőre vonatkozó követelményeket megfontolni.

VI. Záró rendelkezések

65. Az ajánlás a Magyar Nemzeti Bankról szóló 2013. évi CXXXIX. törvény 13. § (2) bekezdés i) pontja szerint kiadott, a felügyelt pénzügyi szervezetekre kötelező erővel nem rendelkező szabályozó eszköz. Az MNB által kiadott ajánlás tartalma kifejezi a jogszabályok által támasztott követelményeket, az MNB jogalkalmazási gyakorlata alapján alkalmazni javasolt elveket, illetve módszereket, a piaci szabványokat és szokványokat.
66. Az ajánlásnak való megfelelést az MNB az általa felügyelt pénzügyi szervezetek körében az ellenőrzési és monitoring tevékenysége során figyelemmel kíséri és értékeli, összhangban az általános európai felügyeleti gyakorlattal.
67. Az MNB felhívja a figyelmet arra, hogy a pénzügyi szervezet az ajánlás tartalmát szabályzatai részévé teheti. Ebben az esetben a pénzügyi szervezet jogosult feltüntetni, hogy vonatkozó szabályzatában foglaltak megfelelnek az MNB által kiadott vonatkozó számú ajánlásnak. Amennyiben a pénzügyi szervezet csupán az ajánlás egyes részeit kívánja szabályzataiban megjeleníteni, úgy az ajánlásra való hivatkozást kerülje, illetve csak az ajánlásból átemelt részek tekintetében alkalmazza.
68. Az MNB a jelen ajánlás alkalmazását 2019. március 31-től várja el az érintett pénzügyi szervezetektől.

Dr. Matolcsy György
a Magyar Nemzeti Bank elnöke

ba) A T napon végrehajtott ügylet bejelentése legkésőbb a következő munkanap zárásáig, azaz T+1 napon megtörténik.

aa) Az MNB előírhat további műszaki eljárásokat és menetrendeket.

bc) Az MNB 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 MNB 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 függnnek.

bd) A fájlok érvényesítését mindegyik hatóságnak el kell végeznie. Ezek az érvényesítési szabályok ellenőrzik az XML fájl szintaxisának helyességét.

be) 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 (egyes 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 MNB 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 MNB tájékoztatja a benyújtó vállalkozást, hogy az ügylet az eszköz érvényesítése alatt függőben van; miután a jelentés a benyújtó vállalkozástól beérkezik, az MNB 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 MNB elfogadja;
- ha az eszköz 7 naptári napon belül megjelenik a referenciaadatok között, viszont az eszköz igazolása miatt tartalmi hiba keletkezik, az ügyletjelentést az MNB elutasítja; ha 7 naptári nap elteltével az eszköz még mindig nem jelenik meg a referenciaadatokban, az MNB 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 MNB azonnal elutasítja;

- ha eszközt/alapterméket kivéve egyéb mezőkkel kapcsolatosan is van tartalmi hiba → az ügyletjelentést az MNB azonnal elutasítja, tehát nem vár további 7 napig. Az azonosított hibákról visszajelzést kell adni.
- bf) A tartalom igazolását csak azokra a fájlokra nézve hajtja az MNB végre, amelyek esetében a fájl szintű érvényesítés sikerrel járt. Tanácsos minden egyes érvényesítési szabályt lefolytatni a fájlban található összes ügyletre nézve.
- bg) Ha valamelyik ügyletjelentés egy vagy több érvényesítési szabálynak nem felel meg, az MNB elutasítja. Az érvényesítési szabályoknak megfelelő jelentéseket a hatóság fogadja el. Előfordulhat, hogy az MNB 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 MNB a T naptól rendelkezésre álló referenciaadatokat használja. Az ügyletek vagy a referenciaadatok késedelmes bejelentésével kapcsolatos ügyek kezelése érdekében a T+1 nap elteltével érvényesített vagy továbbított ügyleteknél az MNB 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.
- bh) 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 MNB valamelyik ügyletjelentést elutasítja, a visszajelzésként küldött üzenet jelezze konkrétan a lefolytatott érvényesítési szabályt és a hiba jellegét.

Tartalomjegyzék

I. Az ajánlás célja és hatálya	1
II. Értelmező rendelkezések.....	2
III. Az ügyletjelentésre vonatkozó ajánlások	2
III.1. I. fejezet – Általános elvek.....	6
III.2. II. fejezet – Blokkok.....	29
III.3. III. fejezet – Kereskedési forgatókönyvek.....	77
III.4. IV. fejezet – Különböző eszköztípusok bejelentése.....	205
IV. A megbízások nyilvántartására vonatkozó ajánlások.....	254
IV.1. I. fejezet – Általános elvek.....	254
IV.2. II. fejezet – Forgatókönyvek	265
V. Az órák összehangolására vonatkozó ajánlások.....	323
VI. Záró rendelkezések	330
VII. Mellékletek.....	331