

Kérdés azonosítószáma	16/2017.
Hivatkozott jogszabály	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 (2017/590 EU Rendelet) (RTS 22)
Témakör	Adatszolgáltatás
Jogszabályhely pontos megnevezése	RTS 22 I. Melléklet 2. tábla 30. és 33. sora
Vonatkozó technikai sztemderd, ESMA Q&A, ESMA iránymutatás	RTS 22, ESMA Guidelines (ESMA/2016/1452) on Transaction reporting, order record keeping and clock synchronisation under MiFID II 5
Kérdés	<p>Az RTS 22 szerinti ügyletjelentést milyen módon kell értelmezni nagy volumenű, több részletben teljesített részvény vagy futures megbízások esetén? Több részletben teljesülő megbízás esetén minden egyes megkötött részmennyiségről kell külön riportot készíteni vagy pedig elég egyben a teljes volumen megkötését követően elkészíteni a riportot?</p> <p>Amennyiben az RTS 22 szerinti ügyletjelentést nagy volumenű, több részletben teljesített részvény vagy futures megbízások esetén úgy kell értelmezni, hogy minden egyes megkötött részmennyiségről kell külön riportot készíteni, akkor egy alapkezelő ügyfél megbízásának allokációja megtörténhet-e utólagosan, amennyiben az alapkezelő a különböző alapjai közötti allokációt csak a teljes megbízás teljesülése után adja meg a végrehajtó intézmény részére?</p>
Kérdés háttere	Az Annex I 2. táblájának 30. sorában kell rögzíteni a volument, míg a 33. sorban a teljesülési árat.
MNB álláspont	<p>A 2017/590 EU Rendelet I. Melléklet 2. Táblázat „<i>Ügyletre vonatkozó adatok</i>” mezők értelmében minden végrehajtott ügyletre meg kell adni többek között a Kereskedés dátumát és időpontját (28. mező), Mennyiséget (30. mező) és az Árfolyamát (33. mező). Mivel a részben teljesített ügyletek tekintetében az ügyletre vonatkozó mezők tartalma eltérő, ezért a részteljesítéseket egyedi ügyleteknek kell tekinteni és az ügyletjelentésben külön tételként szükséges szerepeltetni.</p> <p>Az Alapkezelők által több Alap nevében adott megbízások esetében az utólagos allokációnak megfelelően nap végéig meg kell határozni az egyes Alapok részére teljesített ügyleteket. Felhívjuk a figyelmet továbbá arra, hogy nem megfelelő az a gyakorlat, amely szerint több Alap nevében egy Alap ad megbízást.</p>