



A Budapesti Értéktőzsde Zártkörűen Működő  
Részvénytársaság Vezérigazgatójának  
470/2017. sz. határozata

**AZ ÁRU SZEKCIÓ TŐZSDETAGJAIRA VONATKOZÓ  
POZÍCIÓJELENTÉSI KÖTELEZETTSÉGRŐL**

(egységes szerkezetben a Budapesti Értéktőzsde Zártkörűen Működő  
Részvénytársaság vezérigazgatójának a 10/2018 sz. határozatában megállapított  
módosításokkal)

Hatályos: 2018. január 11-étől

A Budapesti Értéktőzsde Zártkörűen Működő Részvénytársaság (a továbbiakban: BÉT) Vezérigazgatója a „Budapesti Értéktőzsde Zártkörűen Működő Részvénytársaság Általános Üzletszabályzata” c. szabályzat Kereskedési Szabályok című Ötödik Könyve I. Rész, 3. fejezet 3.2 pontja és III. Rész 1. fejezet 24/A pontja alapján az alábbiakról dönt.

## 1. A Tőzsdetag pozíciójelentési kötelezettsége

Az Áru Szekcióban kereskedési joggal rendelkező Tőzsdetag minden az Áru Szekcióban kereskedett származékos termék (lejárat, strike) vonatkozásában köteles a BÉT számára a saját maguk, valamint ügyfeleik által és azok ügyfelei által – a végső ügyfél eléréséig – a BÉT-n kötött tranzakciók révén tartott pozíciók adatait minden kereskedési nap 20.00 óráig a 3. pontban meghatározott tartalommal és 2. pontban meghatározott formátumban jelenteni (továbbiakban: Riport), és a Riportot a BÉT és a Tőzsdetag által előre egyeztetett SFTP szerverre feltölteni.

## 2. A pozíciójelentési riport technikai leírása

Fájlformátum: egyszerű, .txt kiterjesztésű text fájl

Fájlnév: TPOZ\_yyyymmdd.txt (pl. TPOZ\_20180120.txt)

Sorszeparátor: windows-os sortörés (\r\n);

Mezőszeparátor: vessző (,)

Fejléc: nincsen

Dátumformátum (date format): yyyymmdd (pl. 20180120)

Szöveghatároló: nincsen

## 3. A pozíciójelentési riport egyes mezőinek tartalma és formátuma

MEZŐ	ADATOK TARTALMA	AZ ADATSZOLGÁLTATÁS FORMÁTUMA
Sorkód	"TPOZ" előtaggal 00001-től kezdődő, növekvő sorszámozás	"TPOZ00001"; ...; "TPOZ99999"
A vonatkozó időszak kezdete (dátum)	A vonatkozó nap dátuma	{DATE_FORMAT}
A vonatkozó időszak vége (dátum)	A vonatkozó nap dátuma	{DATE_FORMAT}
A jelentés benyújtásának dátuma	Ebben a mezőben azt a dátumot kell feltüntetni, amelyben a jelentést benyújtják.	{DATE_FORMAT}
A jelentés hivatkozási száma	Ebben a mezőben a benyújtó által adott, a jelentést a benyújtó és a fogadó illetékes hatóság számára egyaránt egyértelműen azonosító egyedi azonosítót kell feltüntetni.	{ALPHANUM-52}
A jelentett pozíció kereskedési napjának dátuma	Ebben a mezőben azt a dátumot kell feltüntetni, amelyen a jelentett pozíciót az érintett kereskedési helyszínen a kereskedési nap zárásakor birtokolják.	{DATEFORMAT}
A jelentés státusza	Meg kell jelölni, hogy a jelentés új, vagy egy korábban benyújtott jelentés törlése vagy módosítása. Ha egy korábban benyújtott jelentés törlésére vagy módosítására kerül sor, el kell küldeni az eredeti jelentés minden adatát tartalmazó jelentést az eredeti jelentés hivatkozási számát használva, és „A jelentés státusza” mezőben „CANC” jelölést kell feltüntetni. Módosítás esetén új jelentést kell küldeni, amely tartalmazza az eredeti jelentés minden adatát, az eredeti jelentés hivatkozási számát használva, az összes szükséges módosított adattal együtt, és „A jelentés státusza” mezőben „AMND” jelölést kell feltüntetni.	„NEW” – Új „CANC” – Törlés „AMND” – Módosítás
Az adatszolgáltató szervezet azonosítója	Az adatszolgáltató befektetési vállalkozás azonosítója. Ebben a mezőben jogi személyek esetében a jogalany-azonosító kódot (LEI), LEI-vel nem rendelkező természetes személyek esetében pedig a {NATIONAL_ID} azonosítót kell feltüntetni.	{LEI} vagy {NATIONAL_ID} – Természetes személyek

MEZŐ	ADATOK TARTALMA	AZ ADATSZOLGÁLTATÁS FORMÁTUMA
Pozícióbirtokos azonosítója	Ebben a mezőben jogi személyek esetében a jogalany-azonosító kódot (LEI), LEI-vel nem rendelkező természetes személyek esetében pedig a {NATIONAL_ID} azonosítót kell feltüntetni. (Megjegyzés: ha a pozíciót az adatszolgáltató vállalkozás saját pozíciójaként birtokolják, ez a mező megegyezik „Az adatszolgáltató szervezet azonosítója” mezővel).	{LEI} vagy {NATIONAL_ID} – Természetes személyek
A pozícióbirtokos e-mail-címe	A pozícióval kapcsolatos ügyekre vonatkozó értesítésekhez használt e-mail-cím.	{ALPHANUM-256}
Végső anyavállalat azonosítója	Ebben a mezőben jogi személyek esetében a jogalany-azonosító kódot (LEI), LEI-vel nem rendelkező természetes személyek esetében pedig a {NATIONAL_ID} azonosítót kell feltüntetni. Megjegyzés: ez a mező megegyezhet „Az adatszolgáltató szervezet azonosítója” vagy a „Pozícióbirtokos azonosítója” mezővel, ha a végső anyavállalat a saját pozíciót birtokolja, vagy a saját jelentéseit készíti.	{LEI} vagy {NATIONAL_ID} – Természetes személyek
A végső anyavállalat e-mail-címe	Az összesített pozíciókkal kapcsolatos levelezéshez használt e-mail-cím.	{ALPHANUM-256}
Anyavállalat kollektív befektetési forma státusszal	Ebben a mezőben azt kell feltüntetni, hogy a pozícióbirtokos olyan kollektív befektetési vállalkozás-e, amely befektetési döntéseit anyavállalatától függetlenül hozza, az (EU) 2017/591 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 4. cikkének (2) bekezdésében meghatározottak szerint.	„TRUE” – a pozícióbirtokos olyan kollektív befektetési vállalkozás, amely független befektetési döntéseket hoz. „FALSE” – a pozícióbirtokos nem olyan kollektív befektetési vállalkozás, amely független befektetési döntéseket hoz.
Kereskedési helyszíneken kereskedett ügylet azonosító kódja	Az árualapú származtatott termék, kibocsátási egység, vagy az arra vonatkozó származtatott termék azonosítója. Lásd a „Kereskedési helyszín-azonosító” mezőt azon tőzsdén kívüli ügyletek kezelése tekintetében, amelyek gazdaságilag egyenértékűek a kereskedési helyszíneken kereskedett ügyletekkel.	{ISIN}
A helyszín termékkódja (Venue Product Code)	Ebben a mezőben a kereskedési helyszín által használt, különböző lejáratú és kötési árú ügyleteket egyetlen termékben összefogó egyedi és egyértelmű alfanumerikus azonosítót kell feltüntetni.	{ALPHANUM-12}
Kereskedési helyszín-azonosító	Ebben a mezőben a kereskedési helyszín ISO 10383 szabvány szerinti szegmensazonosító MIC-kódját kell feltüntetni a helyszíni ügyletek tekintetében jelentett pozícióknál. Amennyiben a szegmensazonosító MIC-kód nem áll rendelkezésre, a működtetőazonosító MIC-kódot kell feltüntetni. A gazdaságilag egyenértékű, tőzsdén kívüli ügyletekben lévő, helyszínen kívüli pozíciók esetében az „XXXX” MIC-kódot kell használni. A tőzsdén kívül kereskedett jegyzett származtatott ügyletek vagy kibocsátási egységek esetében az „XOFF” MIC-kódot kell használni.	„XBUD”
Pozíció típus	Ebben a mezőben azt kell feltüntetni, hogy a pozíció határidős tőzsdei ügyletekben, opciós ügyletekben, kibocsátási egységekben vagy az azokra vonatkozó származtatott termékekben, a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelv (4) 4. cikke (1) bekezdése 44. pontjának c) alpontjában meghatározott árualapú származtatott termékekben vagy bármely más ügylettípusban áll-e fenn.	„OPTN”– Opciók ügyletek, beleértve a FUTR, SDRV vagy OTHR típusokra vonatkozó elkülönülten kereskedhető opciókat, kivéve azokat a termékeket, ahol az opció csak beágyazott elem „FUTR”– Határidős tőzsdei ügyletek „EMIS”– Kibocsátási egységek és az azokra vonatkozó származtatott termékek „SDRV”– a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdése 44. pontjának c) alpontjában meghatározott árualapú származtatott termékek „OTHR”– bármely egyéb ügylettípus
Pozíció lejárat	Meg kell jelölni, hogy a jelentett pozíciót magában foglaló ügylet lejárat az azonnali hónapra vagy minden egyéb hónapra vonatkozik-e. Megjegyzés: különálló jelentésre van szükség az azonnali hónapokra és minden egyéb hónapra vonatkozóan.	„SPOT”– azonnali hónap, beleértve minden, az EMIS és az SRDV pozíciótypusba tartozó pozíciót „OTHR”– minden egyéb hónap
Pozíció mennyiség	Ebben a mezőben az árualapú származtatott termékben, kibocsátási egységekben vagy az azokra vonatkozó származtatott termékekben birtokolt nettó pozíció mennyiséget kell feltüntetni, tételben kifejezve, ha a pozíciólimiteket tételben fejezik ki, vagy az alaptermék egységében kifejezve. Ebben a mezőben pozitív számot kell feltüntetni hosszú pozíciók esetében és negatív számot rövid pozíciók esetében. Ha a pozíció a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdése 44. pontjának c) alpontjában meghatározott árualapú származtatott termékekben van, a mezőben a birtokolt egységek számát kell feltüntetni.	{DECIMAL-15/2}

MEZŐ	ADATOK TARTALMA	AZ ADATSZOLGÁLTATÁS FORMÁTUMA
A pozíciómennyiség jelölése	Ebben a mezőben a pozíciómennyiség megadásához használt egységet kell feltüntetni.	„LOTS”- ha a pozíciómennyiséget tételekben fejezik ki {ALPHANUM-25}- a használt egységek leírása, ha a pozíciómennyiséget az alaptermék egységeiben fejezik ki „UNIT”- ha a pozíciómennyiséget egységekben fejezik ki
Delta-ekvivalens pozíciómennyiség	Ha a pozíció típus „OPTN” vagy az „EMIS”-re vonatkozó opció, akkor ennek a mezőnek a „Pozíciómennyiség” mezőben jelentett pozíciók delta-ekvivalens mennyiségét kell tartalmaznia. Ebben a mezőben pozitív számot kell feltüntetni hosszú vételi pozíciók és rövid eladási pozíciók esetében és negatív számot hosszú eladási pozíciók és rövid vételi pozíciók esetében.	{DECIMAL-15/2}
A pozíció kereskedelmi tevékenységhez kapcsolódó kockázatot csökkentő jellegének mutatója	Ebben a mezőben kell feltüntetni, hogy a pozíció az (EU) 2017/591 felhatalmazáson alapuló rendelet 7. cikke értelmében kockázatcsökkentő-e.	„TRUE”- a pozíció kockázatcsökkentő „FALSE”- a pozíció nem kockázatcsökkentő
Mód	Ebben a mezőben kell feltüntetni, a riport újként lett feltöltve, vagy abban (adott soron) módosítás/javítás történt.	Üres vagy „E”, ha új a jelentés. „M”, ha módosulás/javítás történt adott soron.

Végh Richárd  
elnök-vezérigazgató