



Az order audit trail-hez (RTS24) szükséges új adatok és ajánlati mezők a BÉT azonnali piacán (Xetra)

Annak érdekében, hogy a Budapesti Értéktőzsde megfeleljen az RTS24-ben („Maintenance of relevant data relating to orders in financial instruments”) felállított követelményeknek a tagjaitól számos új információt kell bekérnie az ajánlatokhoz kapcsolódóan.

Ezeket az új adatokat és az ehhez kapcsolódó kiegészítő információkat a Xetra Kereskedési rendszer új ajánlatbeviteli mezőiben szükséges megadni, melyek az alábbiak:

- Client ID
- Executing Trader Indicator (kizárólag interface-en)
- Executing Trader (kizárólag interface-en)
- Investment Decision Indicator
- Investment Decision Maker
- Liquidity provision

A Client ID, Executing Trader, Investment Decision Maker esetén ún. short code kerül alkalmazásra, melynek lényege, hogy a kereskedési rendszerben nem a MiFID által előírt értéket kell beírni (National ID, LEI kód), hanem a tőzsdetagoknak az adatokhoz egy számkódot (short code) kell hozzárendelnie (figyelembe véve, hogy vannak fix, a tőzsde által előre lefoglalt kódok), és ezt szükséges megadni az ajánlat beadás során a kereskedési rendszerben.

A short code-hoz tartozó adatokat (long code) a kereskedési rendszeren kívül kell megküldeni a tőzsdének.

A tőzsde az ún. audit trail (felügyelet számára előállítandó) riportban mindig a short code-hoz tartozó long code-ot (National ID, LEI kód) jeleníti meg.

Új Xetra ajánlati mezők kitöltése

1. Client ID

A mezőt az alábbi értékekkel lehet kitölteni:

- Short code (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)
- Üres: nem ügyfél megbízás
- 1: összevont ajánlatok (AGGR)
- 2: függő megbízás (PNAL)



Agent szerepkörben beadott (megbízói, nem saját számlás) ajánlatok esetén a mező nem hagyható üresen (feltételesen kötelező mező), érték hiányában az ajánlat visszautasításra kerül.

Amennyiben nem ügyfélmegbízásról van szó, úgy a mező értékét üresen kell hagyni, azonban bizonyos Xetra interface-eken „0” érték kitöltése is megengedett

Ügyfélmegbízás esetén a mező kitölthető short code-al, vagy az előre meghatározott '1'-es vagy '2'-es értékekkel. Ha az ügyfél az '1'-es értékkel tölti ki a mezőt, úgy a megbízás az audit trail riportban összevont megbízásként (AGGR), kerül feltüntetésre, míg ha '2'-es értéket viszi fel a tag, úgy az audit trail riport megfelelő mezője függő allokációként (PNAL) fog megjelenni.

Sem az összevont ajánlat, sem a függő allokáció státusz a későbbiekben nem kerül módosításra a tőzsde rendszerében, azaz nem kell utólag megadni, hogy végül kihez is tartozott a megbízás.

2. Executing Trader Indicator (kizárólag interface esetén)

A mezőt az alábbi értékekkel lehet kitölteni:

- 0 vagy üres: természetes személy felel a végrehajtásért
- 1: algoritmus felel a végrehajtásért

A megfelelő kitöltés fontos, hiszen ez a mező határozza meg az „Executing Trader” mező kitöltését.

Front-enden (JTrader, WebTrader, CEE Trader) nem módosítható, ott az alapértelmezett értéke 0 vagy üres lesz.

3. Executing Trader (kizárólag interface esetén)

A mező a következő értékeket veheti fel:

- Algoritmus azonosító (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám): algoritmus felel a végrehajtásért
- Short code (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám): olyan természetes személy, mely eltér a beküldő üzletkötőtől (trader-től)
- Üres: a beküldő üzletkötő (trader) felel a végrehajtásért
- 3: ügyfél felelt a végrehajtásért

Front-enden nem tölthető, alapértelmezett érték „üres”

Amennyiben az „Executing Trader Indicator” mező az 1-es értéket veszi fel, az „Executing Trader” mező csupán az algoritmus azonosítóval tölthető.

Amennyiben az „Executing Trader Indicator” mező 0 vagy üres értéket veszi, úgy a mezőben a végrehajtásért felelős természetes személyhez tartozó short code-ot kell a tőzsdetagnak feltüntetnie.



A tag üresen is hagyhatja a mezőt, ha az Executing Trader Indicator mező értéke 0 vagy Üres. Ekkor az audit trail-ben az ajánlatot beadó üzletkötő National ID-ja kerül majd rögzítésre.

A BÉT minden tőzsdetagjától előre külön bekéri minden üzletkötő National ID-ját, és azt a megfelelő trader ID-hoz fogja társítani (interface esetén is kötelező a bejelentett természetes személy üzletkötő), így az ajánlatot beadó kereskedő National ID-ja ismert lesz anélkül, hogy azt a tagnak külön az ajánlat beadáskor rögzíteni kellene.

Amennyiben a végrehajtásért az ügyfél felel, a 3-as értéket kell megadni, ebben az esetben a Client ID-ban feltüntetett short code-hoz tartozó long code kerül be az audit trail jelentésbe.

Fontos, hogy csak olyan ügyfélmegbízás esetén működik az ügyfél, mint végrehajtásért felelős személy megjelölése fix 3-as értékkel, ahol short code megadásra került a Client ID mezőben (1-es „AGGR” és 2-es „PNAL” vagy üres értékek esetén sem működik).

Abban az esetben, ha a Client ID értéke 1 vagy 2, vagy saját számlás kereskedés esetén helyeznek el 3-as számot, úgy mindig a beküldő üzletkötő (trader ID) lesz feltüntetve, mint a végrehajtásért felelős személy (mintha üresen lett volna hagyva a mező).

4. Investment Decision Indicator

A mezőt az alábbi értékekkel lehet kitölteni:

- 1: algoritmus felel a befektetési döntésért
- 2: természetes személy felel a döntésért
- 0 vagy üres: nem alkalmazandó/ügyfél megbízás

Ügyfélmegbízás esetén a mezőt üresen kell hagyni (front-end) vagy 0 értékkel kitölteni (bizonyos Xetra interface-eken az értékkészlet között szerepel a 0). Ez alól kivételt képez, ha az ügyfélszámlán a befektetési döntést a tőzsdetagon belül hozták meg, ebben az esetben ügyfél megbízás esetén is értelmezhető a mező. (pl. vagyongekeztelt ügyfél)

A megfelelő kitöltés fontos, hiszen ez a mező határozza meg az „*Investment Decision Maker*” mező kitöltését.

5. Investment Decision Maker

A mezőt az alábbi értékekkel lehet kitölteni:

- Algoritmus azonosító (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)
- Short code (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)
- Üres

Amennyiben az „*Investment Decision Indicator*” 1-es értékkel lett rögzítve, úgy ez a mező csupán az algoritmus azonosítóval tölthető.

Amennyiben az „*Investment Decision Indicator*” 2-es értékkel került rögzítésre úgy ebben a mezőben a tőzsdetagnak a befektetési döntést meghozó természetes személyhez tartozó short code-ot kell feltüntetni, működése megegyezik a Client ID, és az Executing Trader



részek alatt bemutatottakkal. Ha az Investment Decision Maker mező üresen van hagyva az ajánlatot beküldő traderID-hoz bejelentett üzletkötő felel a befektetési döntésért.

Ha az „*Investment Decision Indicator*” mező üresen lett hagyva (vagy 0-val lett kitöltve) akkor mezőt nem kell tölteni mivel a befektetési döntést nem a tőzsdetag szervezetén belül hozták meg

6. Liquidity Provision

A mezőt az alábbi értékekkel lehet kitölteni:

- 1 (interface) vagy check box kipiálva (front-end): saját számlás árjegyzői tevékenység
- Check box üresen hagyva: nem saját számlás árjegyzői tevékenység

Ha az ajánlat árjegyzői ajánlat, úgy a check bokszt ki kell pipálni, míg, ha az ajánlat nem árjegyzői úgy üresen kell hagyni. Árjegyzés csak saját számlás kereskedés esetén értelmezhető.



Összefoglaló

Új mezők audit trail miatt és lehetséges értékeik					
ClientID	Executing Trader Indicator	Executing Trader	Investment Decision Indicator	Investment Decision Maker	Liquidity Provision
Üres - nem ügyfélmegbízás	0 vagy Üres- természetes személy felel a végrehajtásért	Algoritmus azonosító (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)	1- algoritmus felel a befektetési döntésért	Algoritmus azonosító (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)	Check box kipiálása - árjegyzői ajánlat
1 - összevont ajánlatok (AGGR)	1- algoritmus felel a végrehajtásért	Short code (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)	2- természetes személy felel a befektetési döntésért	Short code (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)	Check box üresen hagyása - nem árjegyzői ajánlat
2- függő megbízás (PNAL)		Üres	0 vagy Üres	Üres	
Short code (8 byte méretű 9-nél nagyobb pozitív természetes szám)		3			
Mikor kötelező a mezőt? (technikailag)					
Feltételeken kötelező mező: Ügyfél megbízás (Agent) esetén nem hagyható üresen.	Front-enden nem tölthető, ekkor alapértelmezett érték 0 vagy üres. Nem kötelező mező (üresen hagyható)	Front-enden nem tölthető, ekkor alapértelmezett értéke üres. Ha az ajánlatot beküldő trader felel a végrehajtásért üresen kell hagyni. Feltételeken kötelező mező: ha Executing Trader Indicator 1, akkor nem hagyható üresen	Nem kötelező mező (üresen hagyható)	Feltételeken kötelező mező, ha Investment Decision Indicator 1, akkor nem hagyható üresen.	Nem kötelező mező: üresen hagyható.

Short code-hoz tartozó long code megadásának folyamata (Xetra)

A BÉT más európai kereskedési rendszerek által nyújtott megoldáshoz hasonlóan használni fogja a short code-al való kitöltés lehetőségét az azonnali piacán. A short code-al történő kitöltés során a tőzsdetagnak azt a short code-ot kell a mezőben rögzítenie, melyet egy



külön fájlként a hozzá tartozó long code-al egy külön csatornán eljuttat a tőzsdéhez, és folyamatosan karban tart.

Fontos, hogy a long code-ok helyes megadása minden esetben a tőzsdetag felelőssége.

A BÉT a short code-ok, illetve a hozzá tartozó long code-ok bekérését a WBAG-tól és a DBAG-tól függetlenül de az általuk alkalmazott technikai megoldással szinte teljes mértékben megegyező saját megoldás keretében fogja a tagoktól bekérni.

Ennek pontos specifikációja külön kerül meghatározásra és közzétételre.

Kapcsolódó dokumentáció

- A BÉT által közzétett leírás a short code-hoz tartozó long code adatok felöltéséről
- DBAG által kiadott Xetra 17.0 Release Description és interface leírások
- WBAG által kiadott CEESEG FIX specifikációk és CEE Trader leírás



National client identifiers for natural persons to be used in transaction reports

ISO 3166	Country Name	1st priority identifier	2nd priority identifier	3rd priority identifier
AT	Austria	CONCAT		
BE	Belgium	Belgian National Number (Numéro de registre national — Rijksregisternummer)	CONCAT	
BG	Bulgaria	Bulgarian Personal Number	CONCAT	
CY	Cyprus	National Passport Number	CONCAT	
CZ	Czech Republic	National identification number (Rodné číslo)	Passport Number	CONCAT
DE	Germany	CONCAT		
DK	Denmark	Personal identity code 10 digits alphanumeric: DMMYYXXXX	CONCAT	
EE	Estonia	Estonian Personal Identification Code (Isikukood)		
ES	Spain	Tax identification number (Código de identificación fiscal)		
FI	Finland	Personal identity code	CONCAT	
FR	France	CONCAT		
GB	United Kingdom	UK National Insurance number	CONCAT	
GR	Greece	10 DSS digit investor share	CONCAT	
HR	Croatia	Personal Identification Number (OIB — Osobni identifikacijski broj)	CONCAT	
HU	Hungary	CONCAT		
IE	Ireland	CONCAT		
IS	Iceland	Personal Identity Code (Kennitala)		
IT	Italy	Fiscal code (Codice fiscale)		
LI	Liechtenstein	National Passport Number	National Identity Card Number	CONCAT
LT	Lithuania	Personal code (Asmens kodas)	National Passport Number	CONCAT
LU	Luxembourg	CONCAT		
LV	Latvia	Personal code (Personas kods)	CONCAT	
MT	Malta	National Identification Number	National Passport Number	
NL	Netherlands	National Passport Number	National identity card number	CONCAT
NO	Norway	11 digit personal id (Foedselsnummer)	CONCAT	
PL	Poland	National Identification Number (PESEL)	Tax Number (Numer identyfikacji podatkowej)	
PT	Portugal	Tax number (Número de Identificação Fiscal)	National Passport Number	CONCAT
RO	Romania	National Identification Number (Cod Numeric Personal)	National Passport Number	CONCAT
SE	Sweden	Personal identity number	CONCAT	
SI	Slovenia	Personal Identification Number (EMŠO: Enotna Matična Številka Občana)	CONCAT	
SK	Slovakia	Personal number (Rodné číslo)	National Passport Number	CONCAT
All other countries		National Passport Number	CONCAT	