

BÉT derivatív kereskedés (MMTS II): MiFID miatt tervezett változások leírása

Tisztelt Tőzsdetagok!

Szeretnénk tájékoztatni Önöket, hogy a BÉT derivatív kereskedési rendszereiben (MMTS II.) a MiFID miatt tervezett változások technikai leírását tartalmazó dokumentáció elérhető a BÉT honlapján:

<https://bet.hu/Tozsdetagoknak/Technikai-informaciok>

K2 dokumentáció (tervezett MiFID II. release 2017):

https://bet.hu/pfile/file?path=/site/Magyar/Dokumentumok/Tozsdetagoknak/Technikai_informacio_k/K2_doc_2017_MiFID.zip1

1. A K2 interface-en beküldött vagy módosított ajánlatok (normál és árjegyzői) esetén egy új opcionális (üresen hagyható) ExecutionID mezőben lehetőség van a megbízásból származó tranzakció végrehajtásáért felelő személy („Execution within the firm”) National ID vagy ALGO azonosítójának megadására (magát az azonosítót, nincs szükség az azonnali piacon tervezett short code-hoz hasonló eljárásra). Amennyiben a mező nincs kitöltve, akkor az azt jelzi a tőzsde felé, hogy a végrehajtásért az a személy felelt, akinek a neve be van (lesz) jelölve a K2 felhasználói azonosítóhoz, ennek megfelelően a felügyeleti riporting (order record keeping) során őt fogjuk feltüntetni.
2. Az időbélyegzők (ajánlatok és kötések) pontossága millisecundum-ra finomodik.

MMTS II Kereskedési Munkaállomás Felhasználói útmutatója (tervezett MIFID II. release 2017):

https://bet.hu/pfile/file?path=/site/Magyar/Dokumentumok/Tozsdetagoknak/Technikai_informacio_k/MMTS_II_Hun_TW_UGH_v5.3.docx1

1. Az ajánlatok és kötések ablakban megjelenik a K2 ajánlat beküldés során opcionálisan kitöltött ExecutionID mező értéke. Ez az adat csak az ajánlatot beküldő cég számára lesz látható, a kötésben részt vevő másik fél nem fogja látni.
2. A Trader Workplace-en keresztül megadott ajánlatok esetén nem lesz lehetőség az ExecutionID használatára, kézi ajánlat bevitel esetén minden esetben maga a felhasználó lesz a végrehajtásért felelős személy.
3. Az ajánlatok és kötések itt is millisecundum pontossággal fognak megjelenni.

Egyéb kötelező MiFID ajánlati mezők (KELER KID fejlesztés):

Az order record keeping kötelezettséghez kapcsolódó (RTS 24) egyéb kötelező ajánlati adatok nem a kereskedési rendszerben kerülnek implementálásra.

A korábbi, előzetes tájékoztatásunkkal összhangban a *Client ID, Investment decision within the firm, Liquidity provision flag, Direct Eletronic Acces (DEA) flag* értékei a terveink szerint a KELER KID rendszerében a pozícióvezetési számlákhoz kötelezően kitöltendő adatok lesznek.

Mivel a BÉT derivatív kereskedés során kötelező megadni/kiválasztani a kereskedési számla azonosítót (ami megegyezik a KELER pozícióvezetési számlával), ezért tulajdonképpen ezt használjuk short code helyett, így minimalizálva a MiFID miatti módosításokat a kereskedési rendszerben és nem alakítunk ki teljesen új folyamatot az adatok utólagos bekérésére sem.

Ezeket a (nem ajánlati szinten, hanem kereskedési számla szinten értelmezhető) mezőket az új tervezett KID verzióban a DER alrendszer\PVE felvitel és PVE módosítás export-import adatformátumok bővítése fogja tartalmazni a jelenlegi működéssel megegyezően a KID-ben manuálisan és tömeges importtal is meg lehet adni új pozíció számla felvitelekor.

https://www.keler.hu/Dokumentumt%C3%A1r/KID%20dokument%C3%A1ci%C3%B3/KIDIO%20verzi%C3%B3k/2014_06_30_KIDIO_v6.02-05.pdf?download (jelenlegi verzió)

Amint elkészül az új KIDIO tervezet, részletes leírást küldünk a teljes folyamatról, illetve az új adatok kitöltésének kötelezettségét a BÉT ÁÜSZ-ben tervezzük majd rögzíteni.
Addig is csatolva küldjük a működés vázlatos leírását.

A KID tesztelés a terveink szerint októberben kezdődhet, és az élesítéskor (a tervek szerint december eleje) szükség lesz egy ősfeltöltésre is a már meglévő megbízók és saját számlák adatainak feltöltésére.

Továbbá szeretnénk tájékoztatni Önöket, hogy **a következő személyes tájékoztatást/workshopot a BÉT szeptemberben tervezi, ahová meghívjuk a Wiener Börse képviselőit az azonnali piaccal (Xetra) kapcsolatos változások bemutatására.**

Addig is ha bármilyen kérdésük merülne fel, kérem jelezzék a MIFID@bse.hu címen!

Köszönettel,



Kardos Miklós

Igazgató
Kereskedési és Üzletfejlesztési Igazgatóság

Budapesti Értéktőzsde Zrt.

1054 Budapest, Szabadság tér 7.

Telefon: +36 1 429 6877

Mobil: +36 30 304 9488

E-mail: kardosm@bse.hu

Honlap: www.bet.hu