

Módszertani leírás
a Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya
valamint
a Befektetési szolgáltatók kereskedési adatai
megnevezésű havi jegybanki adatközlésekhez
(2019. május)

Az adatközlések célja, hogy tájékoztatást adjanak a piaci szereplők számára a befektetési szolgáltatók kereskedési és kezelt értékpapír-állományi adatairól. A hitelintézetek, befektetési vállalkozások és fióktelepek által letétkezelt, piaci értéken szereplő idegen tulajdonú értékpapírok állományi adatait tartalmazó publikáció forint, deviza és összesen bontásban, külön bemutatva a nyugdíj előtakarékossági értékpapírszámlák (továbbiakban: NYESZ értékpapírszámlák) és a tartós befektetési értékpapírszámlák (továbbiakban: TBSZ értékpapírszámlák) darabszámát és értékpapír állományát, a kereskedési adataik azonnali és származtatott ügylettípusonként, havi illetve kumulált értéken kerülnek közlésre.

1. A publikációk jellemzői, az adatok tartalma

A Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya valamint a Befektetési szolgáltatók kereskedési adatai megnevezésű jegybanki adatközlések havonta, a tárgyhónapot követő 2. hónap 7. napján jelennek meg a jegybank internetes honlapján.

Az adatok elérhetősége a jegybank honlapján:

Statisztika / Statisztikai adatok, információk / Adatok, idősorok / XIII. Értékpapírok és tőkepiaci információk / Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya

Statisztika / Statisztikai adatok, információk / Adatok, idősorok / XIII. Értékpapírok és tőkepiaci információk / Befektetési szolgáltatók kereskedési adatai

Az adatokat tartalmazó menüpontok egy-egy Excel fájlra mutatnak. Ezek első 2 munkalapján a címlap és tartalomjegyzék, a további munkalapokon az adattáblák találhatóak.

A Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya publikációban azonos szerkezetű adattáblák találhatóak, melyek a 3-5. munkalapokon letétkezelői csoportonként aggregálva tartalmazzák a hitelintézetek, befektetési vállalkozások és fióktelepek forint, deviza és összesen állományait. A 6. munkalapon a letétkezelői csoportok által vezetett NYESZ értékpapírszámlák darabszáma és a NYESZ-számlákon nyilvántartott értékpapír-állományok, a 7. munkalapon a TBSZ értékpapírszámlák darabszáma és a TBSZ-számlákon nyilvántartott értékpapír-állományok kerülnek ismertetésre. Az idegen tulajdonú értékpapír-állományok piaci értéken, milliárd forintban kerülnek bemutatásra.

A Befektetési szolgáltatók kereskedési adatai publikációban 4 azonos szerkezetű adattábla van, melyek befektetési szolgáltatói csoportonként és összesítve is tartalmazzák a hitelintézetek, befektetési vállalkozások és fióktelepek azonnali és származtatott ügyleteinek havi illetve kumulált forgalmi értékét. A kereskedési adatok tőzsdei és nem tőzsdei ügyletek szerinti bontásban jelennek meg, melyek további részletezése a saját számlás, illetve a megbízás alapján teljesített forgalmat mutatja be. A megbízásos forgalmak devizabelföldi és devizakülföldi megbízók szerint aggregálva jelennek meg, míg a saját számlás forgalom devizabelföldi és devizakülföldi partner szerinti bontásban. A származtatott ügyletek kötészori értéken szerepelnek.

2. A publikációk adatforrásai

A Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya publikáció 3-5. munkalapjain megjelenő adatok forrása a 2012. decemberi vonatkozású idejű adatokig a PSZÁF 31D2 jelű adatgyűjtése, a 2013. januári vonatkozású idejű adatoktól kezdődően pedig az MNB adatszolgáltatási rendeletében előírt, értékpapírokkal kapcsolatos (E jelzésű) adatgyűjtések adataiból készülő értékpapír-statisztikai feldolgozás. (Részletesen lásd: A rezidens kibocsátású értékpapírok adatai kibocsátói és tulajdonosi bontásban adatközléshez készült módszertani leírásban.) A 6-7. munkalapokon található idősoros adatok forrása az alábbi felügyeleti célú adatszolgáltatás:

31D1 Tájékoztató adatok (2)

A Befektetési szolgáltatók kereskedési adatai elnevezésű publikáció az alábbi felügyeleti célú adatszolgáltatások adataiból készül:

35A Tőzsdei kereskedési tevékenység havi forgalmi adatai értékpapír fajtánként illetve a származtatott ügyletek típusai szerint, valamint saját számlás/devizabelföldi/devizakülföldi/továbbított megbízások szerinti bontásban

35B Tőzsdén kívüli kereskedési tevékenység havi forgalmi adatai értékpapír fajtánként illetve a származtatott ügyletek típusai szerint, valamint saját számlás/devizabelföldi/devizakülföldi/továbbított megbízások szerinti bontásban

35C Értékpapírok valamint származtatott ügyletek tőzsdei és tőzsdén kívüli összesített forgalma partnerek, illetve megbízók szerint

A publikált kereskedési adatok a továbbított forgalmat nem tartalmazzák.

3. A Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya publikáció változása 2014-től, majd 2017-től

A Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya adatközlés 3-5. munkalapjainak adatai 2014-től kezdődően változatlan szerkezetben, azonban módosult tartalommal kerülnek közzétételre. Ezek az adatok 2013. januári vonatkozású időszaktól kezdődően nem a felügyeleti célú adatgyűjtésekből, hanem az értékpapír-statisztikai célú adatgyűjtések adataiból kerülnek összeállításra.

A legjelentősebb módszertani változás az állományok értékelésének különbözőségéből adódik. 2012 végéig az idegen tulajdonú értékpapírok állományának meghatározása az adatszolgáltatók saját könyveiben szereplő, egyedi árazás alapján kiszámított értékek összesítésével történt. A 2013. januári tárgyidőszaktól kezdődően viszont az értékpapírok állományának meghatározása a jegybanki értékpapír-statisztika központi nyilvántartása és árazása alapján készül, ami biztosítja, hogy egy értékpapírhoz csak egy ár tartozhat, mely az elérhető legjobb árforrásból származik. 2017-től változott a nem tőzsdei részvények árazási módszere, ami 2013. januárig visszamenőlegesen érvényesítésre került az adatokon.

További módszertani eltérés mutatkozik a kamatozó értékpapírok számbavételénél, mert a felügyeleti statisztikákban a nettó, felhalmozott kamatot nem tartalmazó piaci érték szerepelt a jelentésekben és az adatközlésekben, ezzel szemben 2014-től kezdődően (2013. januárig visszamenően) a többi értékpapír-statisztikai publikációjához hasonlóan az állományok már tartalmazzák a felhalmozott kamatot is.

A fentiekén túl eltérést okoz továbbá az adatokban az adatszolgáltatói kör minimális változása, illetve, hogy az értékpapír-statisztikában az értékpapírok másodlagos letétkezelése miatti halmozódások az állományokban kiszűrésre kerülnek.

2017-től a Befektetési szolgáltatók által kezelt idegen tulajdonú értékpapírok állománya adatközlésben új, 6-7. munkalapokon jelenítjük meg a NYESZ és TBSZ értékpapírszámlák darabszámát, valamint az ezen számlákon nyilvántartott értékpapír-állományokat 2013-ig visszavezetve.