

*Kiegészítés a D01, MNB jelű jelentést készítő program  
útmutatójához*

<b>1</b>	<b>A D01-ES JELENTÉS FELDOLGOZÁSÁNAK MENETE (VÁZLAT)</b>	<b>2</b>
<b>2</b>	<b>ÖSSZEFÜGGÉS AZ ÁLLOMÁNYI ÉS FORGALMI ADATOK KÖZT</b>	<b>3</b>
<b>3</b>	<b>A KONVERZIÓS ÉS SWS ÜZLETEK KEZELÉSE</b>	<b>4</b>
<b>4</b>	<b>AZ ADATBÁZIS FŐBB ADATTÁRAI</b>	<b>5</b>
4.1	Napi forgalmi és állományi adatok	5
4.2	Archív adatok	5
4.3	Nyitott spot üzeletek	5

## 1 A D01-es jelentés feldolgozásának menete (vázlat)

1. Napzárás/napnyitás
2. A lejárt tételek ellenőrzése, menüpont: kiíratás (tényleg az járt-e le, amire gondoltunk).
3. Aznapai árfolyam, forgalmi tételek, állományok rögzítése.
4. Jelentéskészítés.
5. Nyitott pozíció ellenőrzése (limittúllépés)
6. (Állományok ellenőrzése (nagyságrendileg)) – oda vittük-e be az adatokat, ahova akartuk ( rövid/hosszú, külföld/belföld, stb. bontás )
7. (Tartalékváltozás ellenőrzése nagyságrendileg)
8. Ha korrigálni kell, 3. ponttól újra, egyébként lemezkészítés, GIROMail file-ok készítése, jelentés nyomtatása, MNB felé elküldése.
9. 1. pont.

### MNB részéről

- Jelentések befogadása
- Ellenőrzések:
  - Formai ellenőrzések: mezőtípusok, értékek, azonosítók (deviza, bank, stb.), kódok, árfolyamdifferenciák.
  - Tartalmi ellenőrzések: állományok, nyitott pozíció, (tartalék)
  - Nyitott pozíciós limit
  - Bankközi, határidős, konverziós üzetek az MNB-vel és a belföldi kereskedelmi bankokkal.
- Jelentések összesítése, összesítések ellenőrzése, jelentések továbbítása.

## 2 Összefüggés az állományi és forgalmi adatok közt

**T. napi állomány = T-1. napi állomány +/- T. napi forgalom**

**T. napi forgalom =**

**= T. napi (automatikusan) lejáró tételek +/- T. napi induló tételek**

**Bankközi felvétek állománya (T. nap) =**

= Bankközi felvétek állománya (T-1. nap) + új felvétek (T. nap) - lejáratok (T.nap)

**Bankközi kihelyezések állománya (T. nap) =**

= Bankközi kihelyezések állománya (T-1. nap) + új felvétek (T.nap) - lejáratok (T.nap)

**Finanszírozó felvétek állománya (T. nap) =**

= Finanszírozó felvétek állománya (T-1. nap) + új felvétek (T.nap) - lejáratok (T.nap)

**Finanszírozó kihelyezések állománya (T. nap) =**

= Finanszírozó kihelyezések állománya (T-1. nap) + új felvétek (T.nap) - lejáratok (T.nap)

**Határidős követelések állománya (T.nap) =**

Határidős követelések állománya (T-1.nap)

+TRM és SWT vételi oldala (T.nap)

-TRM lejárat és SWT lejárat vételi oldala (T.nap)

**Határidős tartozások állománya (T.nap) =**

Határidős tartozások állománya (T-1.nap)

+TRM és SWT eladási oldala (T.nap)

-TRM lejárat és SWT lejárat eladási oldala (T.nap)

**Értékpapír követelés állomány (T.nap) =**

Értékpapír követelés állomány (T-1.nap)

+ idegen értékpapír vétel (T.nap)

- idegen értékpapír eladás (T.nap)

- idegen értékpapír lejárat (T.nap)

- saját értékpapír (újra)eladás (T.nap)

+ saját értékpapír vétel (T.nap)

### **3 A konverziós és SWS üzelek kezelése**

A konverziós üzelek és a swap spot (SWS) üzelek üzelekötés napján kerülnek bevitelre. A SWS üzeleknél az értéknapi a tényleges értéknapi, lejárat az üzelehez tartozó swap termin (SWT) lejáratának napja. A SWS és konverziós üzeleknél az értéknapi az a nap, amelyikre a pénzösszegek (vétel, eladás) az ügyfél/bank számláján (nostro, vagy loro) jóváírásra/terhelésre kerülnek.

A program szempontjából ez azt jelenti, hogy

- Üzelekötés napján kerülnek bevitelre
- A program az üzelek értéknapijái a nyitott pozícióba az üzeleket beszámítja. Ha a felvételezés napja és az értéknapi azonos (aznapi értéknapi üzelek) az üzelek csak a forgalomban és a tartalékban jelenik meg.
- Napzárás után az üzelek a többi típushoz hasonlóan archiválódnak. Ekkor ezzel párhuzamosan a program egy külön táblázatban tartja nyilván a még nem lejárt konverziós és SWS üzeleket.
- Lejárat napján ebből a táblázatból törlődnek, a tartalék megfelelő részébe beszámítódnak, majd napzárta után végleg törlődnek és ettől kezdve csak az archiv adatok közt megtalálhatóak.

## **4 Az adatbázis főbb adattárai**

### **4.1 Napi forgalmi és állományi adatok**

Ide kerülnek be a tárgynapon kézzel felvételezett, vagy gépi úton betöltött adatok. Az adattáblák a nap zárásakor törlődnek, tartalmuk az archív adatbázisba kerül. Az állományból a program csak az aktuálisat tárolja, ehhez számítja hozzá a tárgynapi forgalmat a jelentés készítésekor, majd az így kiszámított állományt írja be aktuálisként napzáráskor.

### **4.2 Archív adatok**

Ide kerülnek be a tárgynapon kézzel felvételezett, vagy gépi úton betöltött adatok napzárás után. A pozícióvezető ezekkel az adatokkal dolgozik, kivéve a spot ügyleteket, amelyek külön vannak nyilvántartva, tételesen lejáratuk napjáig.

### **4.3 Nyitott spot üzletek**

Napzárás után ide (is) kerülnek az előző nap felvett/betöltött üzletek és lejáratukig itt maradnak, akkor törlődnek és a másolati példányuk az archív adatok közt marad meg.