

VÄÄRTPABERITEHINGUTEST FINANTSINSPEKTSIOONI TEAVITAMISE TEHNILISED TINGIMUSED

Finantsinspeksioon 2012

SISUKORD

1	ÜLDSÄTTED.....	3
1.1	Tehniliste tingimuste andmise alus.....	3
1.2	Tehniliste tingimuste eesmärk	3
2	TEAVITUSSÜSTEEMI OSAD, TEAVITAJATE LIIGID. NÄITED.....	4
2.1	Süsteemi osad	4
2.2	Süsteemi ülesehitus	4
2.2.1	Suur teavitaja.....	4
2.2.2	Väike teavitaja	4
3	ANDMETEAVITUS JA -FORMAADID	6
3.1	Teavitajate andmed.....	6
3.2	Teavituse tüübid	6
3.2.1	Uus teavitus	6
3.2.2	[C] Tühistav teavitus	6
3.3	Väljade kohustuslikkuse tasemed.....	6
3.4	Tehinguandmete formaat.....	6
4	ARUANDE SISUOSA ANDMEVÄLJAD.....	8
4.1	[101] Väärtpaperitehingu kuupäev (K).....	8
4.2	[102] Väärtpaperitehingu kellaaeg (K).....	8
4.3	[103] Kellaaja ajavööndi märke (K).....	8
4.4	[104] Tehingu ostu või müügi märke (K).....	8
4.5	[105] Tehing kliendi arvel või oma arvel (K).....	8
4.6	[106] Väärtpaperi tunnuse tüüp (K).....	9
4.7	[107] Väärtpaperi tunnused (K).....	9
4.7.1	[108] AII kauplemisskoha tunnus (T)	10
4.7.2	[109] AII kauplemisskoha tootetunnus (T)	10
4.7.3	[110] AII tuletisinstrumenti tüüp (T).....	10
4.7.4	[111] AII ostu- või müügioptsiooni tunnus (T)	11
4.7.5	[112] AII lunastamise/väärtus-/täitmise kuupäev (T).....	11
4.7.6	[113] AII täitmishind (T).....	11
4.7.7	[114] Alusvara tunnus (T)	11
4.7.8	[115] Markit clip tunnus (T).....	12
4.7.9	[116] Tuletisinstrumenti tüüp (T)	12
4.7.10	[117] Ostu- või müügioptsiooni tunnus (T).....	12
4.7.11	[118] Hinnakordaja (T).....	13
4.7.12	[119] Täitmishind (T)	13
4.7.13	[120] Aegumise/väärtus-/täitmise kuupäev (T)	13
4.8	[121] Hind (K)	13
4.9	[122] Hinna esitus (K)	14
4.10	[123] Kogus (K)	14
4.11	[124] Vastaspoole tunnus (K).....	14
4.12	[125] Kliendi tunnus (T).....	14
4.13	[126] Täitmiskoha tunnus (K)	15
4.14	[127] Tehingu viitenumber (K)	15
4.15	[128] Tühistamise tunnus (T)	15
5	Lisad	16
5.1	XML aruannete vormindamine	16
5.2	Aruannete krüptimine ja allkirjastamine	16
5.3	Võtmehaldus.....	16
5.4	Aruandefailide edastamine	17
5.4.1	Aruandefailide edastamine	17
5.4.2	XML-automaadi vastused saabuvatele sõnumitele	17
5.4.3	Tagasiside veakoodid ja sisu	17

1 ÜLDSÄTTED

1.1 Tehniliste tingimuste andmise alus

Käesolevad tehnilised tingimused on kehtestatud Finantsinspektsiooni seaduse § 55 lõike 1, Rahandusministri 14.07.2007 määruse nr 52 „Väärtpaberitehingutest Finantsinspektsiooni teavitamise kord” § 2 lõike 2 ja Euroopa Komisjoni määrus (EÜ) nr 1287/2006 artikkel 12 lg 1 punkti e ja lg 2 ning artikkel 13 lg 1 alusel.

1.2 Tehniliste tingimuste eesmärk

Väärtpaberituru seaduse (edaspidi ka VPTS) § 91 kohustab investeerimisühinguid teavitama Finantsinspektsiooni (edaspidi ka FI) tehingutest reguleeritud turule kauplemiseks võetud väärtpaberitega. Esitatud tehinguandmed säilitatakse andmebaasis ning neid kasutatakse väärtpaberituru osaliste turukäitumise analüüsimiseks ning turukuritarvituste avastamiseks.

Tehniliste tingimuste eesmärk on anda juhised seaduses sätestatud teavituse Finantsinspektsioonile elektroonilise XML (*eXtensible Markup Language*) aruandefailina esitamiseks.

2 TEAVITUSSÜSTEEMI OSAD, TEAVITAJATE LIIGID. NÄITED

2.1 Süsteemi osad

Tehingutest teavitamissüsteemi osad on järgmised:

- FI XML-automaat
 - o FI XML-automaadi teavitajate haldus;
 - o FI XML-automaadi veakäsitlus;
- FI andmebaasiserver;
- Suure teavitaja XML-API;
- Väikse teavitaja FI XML-generaator.

2.2 Süsteemi ülesehitus

Investeeringisühingul on kohustus teavitada Finantsinspektsiooni tehingutest väärtpaberitega. Finantsinspektsioon pakub teavitajatele tehnilise lahenduse, mis jagab investeeringisühingud suurteks ja väikesteks teavitajateks. Lahendus on esitatud illustreerival joonisel 1. Investeeringisühingul on vabadus määrata end püsivalt suureks või väikeseks teavitajaks.

2.2.1 Suur teavitaja

Suur teavitaja on investeeringisühing, mille tehtavate tehingute hulk on suur ja sellest tulenevalt andmevahetus Finantsinspektsiooniga mahukas. Selleks esitab Finantsinspektsioon suurtele teavitajatele teavitamissüsteemi spetsifikatsiooni ja XML-skeemid, mille alusel suur teavitaja saab luua uue või täiendada oma olemasolevat süsteemi, et võimaldada ressursiefektiivset tehinguandmete esitamist Finantsinspektsioonile.

Suure teavitaja loodav tehinguteavitusmoodul (API) peab koostama tehingud ning koostama aruandefaili. Aruandefail on XML-formaadis tehingukirjete kogum, mis on koostatud süsteemi spetsifikatsioonis esitatud andmeväljade kirjelduste alusel. Nimetatud andmeväljade kirjeldus on ühine suurele ja väiksele teavitajale.

Koostatud aruandefail edastatakse e-kirja manuseks Finantsinspektsiooni määratud e-posti aadressile. Koondfaili võtab vastu FI XML-automaat. Teavitaja õnnestunud tuvastamise järel teostatakse andmete kontroll (veakäsitlus). Esinenud vigadest teavitab FI XML-automaat teavitajat, mis tähendab samas ka kohustust andmed parandada ning taasesitada Finantsinspektsioonile.

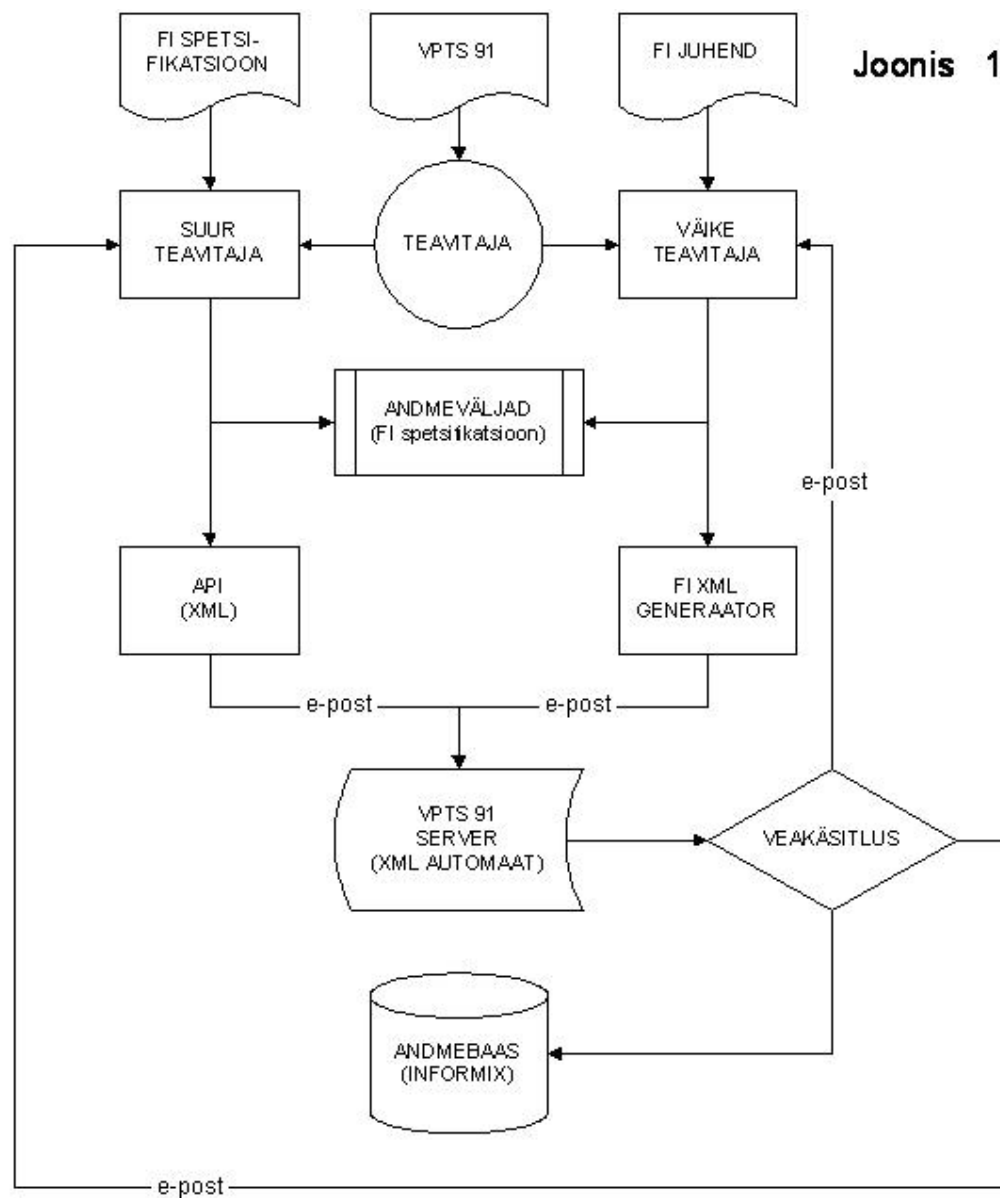
Finantsinspektsioon soovib suurte teavitajatel luua API juurde esitatud tehingute salvestamiseks ja säilitamiseks andmebaas, mis lihtsustab vigaste andmete parandamist ja taasesitamist.

2.2.2 Väike teavitaja

Väike teavitaja saab Finantsinspektsioonilt väikesemahulisteks teavitamiseks eelkoostatud struktuuriga Microsoft Excel'i formaadis faili – XML-generaatori. Nimetatud failis on andmeväljad teavitaja püsiandmete ning tehinguandmete sisestamiseks. XML-generaatori faili täitmise hõlbustamiseks sisaldab see ka vajalikke juhiseid. Nimetatud fail on kättesaadav ja allalaetavad Finantsinspektsiooni kodulehelt¹.

Väike teavitaja peab XML-generaatori abil loodud XML-formaadis aruandefaili saatma Finantsinspektsiooni määratud e-posti aadressile. Teavitaja õnnestunud tuvastamise järel teostatakse andmete kontroll (veakäsitlus). Esinenud vigadest teavitab FI XML-automaat teavitajat, mis tähendab teavitaja jaoks kohustust andmed parandada ning taasesitada.

¹ <http://www.fi.ee/schemas2/1.3/>



3 ANDMETEAVITUS JA -FORMAADID

3.1 Teavitajate andmed

Investeeringisühingud määravad enda sees teavituste eest vastutava(d) isiku(d) (näiteks projektijuht, IT spetsialist) ja teavad nende kontaktandmed Finantsinspeksioonile. Vastutavate isikute ja/või kontaktide muutumise korral tuleb Finantsinspeksiooni vahetult teavitada muutunud andmetest.

Teavitajad esitavad Finantsinspeksioonile järgmised andmed:

Investeeringisühingu nimetus
Kontaktisiku nimi
Kontakttelefon
E-posti aadress
Andmevahetuse eest vastutava isiku nimi
Kontakttelefon
E-posti aadress

Finantsinspeksioon annab investeeringisühingu esindajale tehnilised parameetrid aruandefailide saatmiseks ning veareportite vastuvõtmiseks.

3.2 Teavituse tüübid

Esitatavad teavitused saavad olla kahte tüüpi: 1) uus ja 2) tühistav.

3.2.1 Uus teavitus

Arvesse tuleb võtta väljade kohustuslikkuse tasemeid.

3.2.2 [C] Tühistav teavitus

Tühistamise tunnus „C” tähistab tühistavat teavitust (*cancelled transaction report*).

Tühistav teavitus tühistab eelnevalt saadetud sama identifitseerimisnumbriga teavituse.

3.3 Väljade kohustuslikkuse tasemed

Tulenevalt määruse lisas nr 1 esitatud tabelist saavad andmeväljade kohustuslikkuse tasemed olla järgnevad (käesoleva dokumendi 4. osas toodud andmevälja nime järel sulgudes):

K	Kohustuslik – Vastava teavitusetüübi välja kohta tuleb andmed esitada alati.
T	Tingimuslik – Vastava teavitusetüübi välja kohta tuleb andmed esitada ainult siis, kui need tulenevad teavituse muudest väljadest või muid andmevälju ei ole võimalik täita, nt puudub väärtpaberi ISIN kood ja seetõttu esitatakse muud andmed.

3.4 Tehinguandmete formaat

Tehingutest teavitamisel on lubatud kasutada märke tulenevalt „laiendatud ASCII-märkide” tabelist:

- n : esindab arvu (*digit; INTEGER*);
- a : esindab suurtähte (*letter; CHAR*);
- x : esindab märki (*character; VARCHAR*);
- d : esindab võimalike komakohtadega arvu (*DECIMAL*):

0 arv peab sisaldama vähemalt 1 numbrit;

- o kümnendikega arv peab sisaldama vähemalt 1 numbrit enne kümnendikke eraldavat märki; kümnendikke eraldav märk on punkt „.”;
 - o arvudes ei kasutata tühikuid ega tuhandikke eraldavaid märke;
 - o määrad esitatakse protsentides, nt väärtus 23.45 esindab 23.45% protsenti;
 - o maksimaalne murdosa täpsus: 5 numbrit;
 - o kui tegemist on välja „Hinna esitus” väärtusega, mis on esitatud valuutas, siis murdosa täpsus esitatakse nii nagu ISO valuutatähise standardis (ISO *Currency Code*).
- prefix S: esindab märki + või - (märki + ei ole kohustuslik märkida);
- välja pikkus: väljendatud numbrites, näiteks 3(a) on määratud 3 tähemärgi pikkusega väli; kümnendarvude (*decimal*) märk on osa välja määratud pikkusest;
- Muutuva pikkusega väljad:
 - o Muutuva pikkusega väljad on esitatud prefiksiga „Max”, millele järgneb maksimaalse välja pikkuse väärtus. Näiteks Max19(d) tähistab maksimaalselt 19 numbrit koosnevat arvu kuhu hulka on arvestatud ka märk + või -.
 - o n(n), n(a), n(d) ja n(x) on muutuva pikkusega väljad, kuid mitte üle määratud välja pikkuse väärtuse.

4 ARUANDE SISUOSA ANDMEVÄLJAD

4.1 [101] Väärtpaberitehingu kuupäev (K)

Kuupäev, millal tehing toimus.

YYYY = aasta, MM = kuu, DD = päev

Andmevälja XML tag	TradingDay
Andmevälja formaat	10(x)
Andmevälja väärtused	ISO 8601 kuupäeva formaat; YYYY-MM-DD

4.2 [102] Väärtpaberitehingu kellaaeg (K)

Kellaaeg esitatakse näidates ära tunnid, minutid ja sekundid, millal tehing toimus.

HH = tunnid (00 kuni 23), MM = minutid, SS = sekundid.

Andmevälja XML tag	TradingTime
Andmevälja formaat	8(x)
Andmevälja väärtused	ISO 8601 ajaformaad; HH:MM:SS

4.3 [103] Kellaaaja ajavööndi märke (K)

Tehingu toimumise kellaaaja ajavööndi märke ehk erinevus (+ või -) täistundides võrreldes UTC ajaga.

HH = tunnid (00 kuni 12).

Andmevälja XML tag	TimeIdentifier
Andmevälja formaat	S2(n)
Andmevälja väärtused	ISO 8601 ajaformaad; +/- HH vahemik 00-12

4.4 [104] Tehingu ostu või müügi märke (K)

Lähtuvalt teavitaja positsioonist tehingus näidatakse, kas tehing oli ostu- või müügitehing.

Andmevälja XML tag	BuySellIndicator
Andmevälja formaat	1(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definitsioon
B	Ostutehing (<i>Buy</i>)
S	Müügitehing (<i>Sell</i>)

4.5 [105] Tehing kliendi arvel või oma arvel (K)

Teavitaja näitab, kas ta esindas tehingu tegemisel klienti või tegi seda oma arvel.

Andmevälja XML tag	TradingCapacity
Andmevälja formaat	1(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definitsioon
P	Oma arvel (<i>Principal</i>)
A	Kliendi arvel (<i>Agent</i>)

4.6 [106] Väärtpaberi tunnuse tüüp (K)

Väli “väärtpaberi tunnuse tüüp” määrab koodide kaudu ära, millist tüüpi tehinguteavitusel on tegu – kas ISIN, AII või OTC tuletisväärtpaber.

Andmevälja XML tag	InstrumentIdentification
Andmevälja formaat	Max4(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definitsioon
ISIN	Rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber ISO 6166 – <i>International Securities Identification Number</i> (ISIN)
AII	Alternatiivne identifikaator (<i>Alternative Instrument Identifier</i>) koosneb kuuest tuletisväärtpaberi andmeväljast. Kasutatakse kui väärtpaberile ei ole ISIN koodi omistatud kuid on mõnel EEA ² riigi reguleeritud turul kaubeldav, kus kasutatakse AII-d ³ .
OTC	Turuväline tuletisväärtpaber, millel võib olla ISIN kood ja mille puhul kasutatakse tuletisväärtpaberi andmeväljasid.

4.7 [107] Väärtpaberi tunnused (K)

Väärtpaberile või tuletisväärtpaberile omistatud tunnuscode või andmekomplekt, mille abil on võimalik väärtpaberit identifitseerida. Kui väärtpaberile on määratud ISIN kood on selle kasutamine kohustuslik. Juhul kui tegemist on Euroopa Majanduspiirkonna lepinguriigi reguleeritud turule kauplemiseks võetud väärtpaberiga või tuletisinstrumentidega ning sellele ei ole omistatud ISIN koodi, on teatud kauplemiskohtade puhul kohustuslik kasutada alternatiivset identifikaatorit ehk AII-d. Tuletisväärtpaberitega, mis ei ole võetud reguleeritud turule kauplemiseks, tehtud tehingutest teavitamiseks kasutatakse vastavaid tuletisväärtpaberite andmeväljasid.

Andmevälja XML tag	ISINInstrumentIdentification
Andmevälja formaat	2(a)9(x)1(n)
Andmevälja väärtused	ISO 6166 rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber (ISIN)

Andmevälja XML tag	AIIInstrumentIdentification
Andmevälja formaat	6 AII andmevälja
Andmevälja väärtused	6-e AII andmevälja väärtused

² EEA (ingl. *European Economic Area*) Euroopa Majanduspiirkond

³ AII identifikaatorit kasutavad reguleeritud turud on loetletud [MiFID andmebaasis](#).

Andmevälja XML tag	OTCInstrumentIdentification
Andmevälja formaat	2(a)9(x)1(n) ja 7 tuletisväärt. andmevälja
Andmevälja väärtused	ISO 6166 rahvusvaheline väärtapaberite identifitseerimisnumber (ISIN) ja 7-e tuletisväärtapaberi andmevälja väärtused

4.7.1 [108] AII kauplemisskoha tunnus (T)

Esitamine kohustuslik, kui väärtapaberile ei ole ISIN koodi omistatud, kuid on mõnel EEA riigi reguleeritud turul kaubeldav, kus kasutatakse AII-d. Esimene kokku kuuest AII andmeväljast.

Andmevälja XML tag	AIIXchangeCode
Andmevälja formaat	4(x)
Andmevälja väärtused	ISO 10383 – turu tunnuscode (Market Identifier Code (MIC))

4.7.2 [109] AII kauplemisskoha tootetunnus (T)

Esitamine kohustuslik, kui väärtapaberile ei ole ISIN koodi omistatud, kuid on mõnel EEA riigi reguleeritud turul kaubeldav, kus kasutatakse AII-d. Teine kokku kuuest AII andmeväljast.

Tehingu objektiks olevale tuletisinstrumentidele või väärtapaberile kauplemisskoha poolt omistatud tunnuscode, mis on unikaalne ning tuletatud alusvarast, arveldamise tüübist ja muudest instrumentidele iseloomulikest tunnustest.

Andmevälja XML tag	AIIProductCode
Andmevälja formaat	Max12(x)
Andmevälja väärtused	[tootetunnus]

4.7.3 [110] AII tuletisinstrumenti tüüp (T)

Esitamine kohustuslik, kui väärtapaberile ei ole ISIN koodi omistatud, kuid on mõnel EEA riigi reguleeritud turul kaubeldav, kus kasutatakse AII-d. Kolmas kokku kuuest AII andmeväljast.

Antud andmevälja abil määratakse ära, millist tüüpi tuletisinstrumentiga oli tegu.

Andmevälja XML tag	AIIDerivativeType
Andmevälja formaat	1(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definiitsioon
O	Opsioonileping
F	Futuuri- või muu <i>forward</i> -leping
W	<i>Warrant</i> või muu märkimisõigus
D	<i>Contract for Difference</i> (CfD) või <i>Total Return Swap</i> (TRS)
X	<i>Spread bet</i>
S	<i>Swap</i> ehk vahetusleping
Z	<i>Credit Default Swap</i> (CDS)
K	Kompleksi- või muu keerulisem tuletisleping

4.7.4 [111] AII ostu- või müügioptsiooni tunnus (T)

Esitamine kohustuslik, kui väärtpaperile ei ole ISIN koodi omistatud, kuid on mõnel EEA riigi reguleeritud turul kaubeldav, kus kasutatakse AII-d. Neljas kokku kuuest AII andmeväljast.

Näidatakse, kas tegu on ostu- või müügioptsiooniga. Juhul kui andmeväljal [110] on määratud tuletisinstrumenti tüübiks futuurleping, tuleb antud välja väärtuseks määrata „F”.

Andmevälja XML tag	AIIPutCallIdentifier
Andmevälja formaat	1(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definitsioon
P	Müügioptsioon (<i>Put-option</i>)
C	Ostuoptsioon (<i>Call-option</i>)
F	Futuurleping

4.7.5 [112] AII lunastamise/väärtus-/täitmise kuupäev (T)

Esitamine kohustuslik, kui väärtpaperile ei ole ISIN koodi omistatud, kuid on mõnel EEA riigi reguleeritud turul kaubeldav, kus kasutatakse AII-d. Viies kokku kuuest AII andmeväljast.

Võlakirja lunastamise kuupäev, tuletisväärtpaperi väärtus- või täitmise kuupäev.

YYYY = aasta, MM = kuu, DD = päev

Andmevälja XML tag	AIIPutCallIdentifier
Andmevälja formaat	10(x)
Andmevälja väärtused	ISO 8601 kuupäeva formaat (<i>Date Format</i>); YYYY-MM-DD

4.7.6 [113] AII täitmishind (T)

Esitamine kohustuslik, kui väärtpaperile ei ole ISIN koodi omistatud, kuid on mõnel EEA riigi reguleeritud turul kaubeldav, kus kasutatakse AII-d. Viimane kuuest AII andmeväljast.

Opsiooni täitmishind, mille puhul kümnendike eraldamiseks kasutatakse punkti „.”. Futuuri puhul täitmishind puudub, ehk kui väljal [111] esitati väärtus „F” tuleb käesoleva andmevälja väärtuseks määrata „0”.

Andmevälja XML tag	AIIStrikePrice
Andmevälja formaat	Max19(d)
Andmevälja väärtused	[täitmishind]

4.7.7 [114] Alusvara tunnus (T)

Kui tehingu objektiks oli OTC tuletisväärtpaper, siis on kohustuslik esitada alusvara ISIN kood. Esimene kokku seitsmest OTC andmeväljast.

Andmevälja XML tag	UltimateUnderlyingIdentification
Andmevälja formaat	2(a)9(x)1(n)
Andmevälja väärtused	ISO 6166 rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber (ISIN)

4.7.8 [115] Markit clip tunnus (T)

Kui tehingu objektiks oli OTC tuletisväärtpaber (eelkõige *Credit Default Swap*) ja sellele on Markit Partners'i poolt omistatud tunnuscode⁴, siis on tunnuse esitamine kohustuslik. Teine kokku seitsmest OTC andmeväljast.

Andmevälja XML tag	MarkitClip
Andmevälja formaat 1)	6(x)
Andmevälja formaat 2)	9(x)
Andmevälja väärtused	[CLIP] või [CUSIP]

4.7.9 [116] Tuletisinstrumenti tüüp (T)

Kui tehingu objektiks oli OTC tuletisväärtpaber, siis on kohustuslik esitada tuletisinstrumenti tüübi tunnus. Kolmas kokku seitsmest OTC andmeväljast.

Antud andmevälja abil määratakse ära, millist tüüpi tuletisinstrumentiga oli tegu.

Andmevälja XML tag	DerivativeType
Andmevälja formaat	1(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definitsioon
O	Opsioonileping
F	Futuur- või muu <i>forward</i> -leping
W	<i>Warrant</i> või muu märkimisõigus
D	<i>Contract for Difference</i> (CfD) või <i>Total Return Swap</i> (TRS)
X	<i>Spread bet</i>
S	<i>Swap</i> ehk vahetusleping
Z	<i>Credit Default Swap</i> (CDS)
K	Kompleks- või muu keerulisem tuletisleping

4.7.10 [117] Ostu- või müügioptsiooni tunnus (T)

Kui tehingu objektiks oli OTC opsioonileping ehk andmeväljal [116] on määratud tuletisinstrumenti tüübiks „O“, siis on kohustuslik esitada ostu- või müügioptsiooni tunnus. Neljas kokku seitsmest OTC andmeväljast.

Näidatakse, kas tegu on ostu- või müügioptsiooniga.

Andmevälja XML tag	PutCallIdentifier
Andmevälja formaat	1(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

⁴ http://en.wikipedia.org/wiki/CUSIP_Linked_MIP_Code

Kood	Definitsioon
P	Müügiopsioon (<i>Put-option</i>)
C	Ostuiopsioon (<i>Call-option</i>)
F	Futuurleping

4.7.11 [118] Hinnakordaja (T)

Kui tehingu objektiks oli OTC optsoonileping, futuur- või muu *forward*-leping, *Warrant* või *Swap* ehk andmeväljal [116] on määratud tuletisinstrumenti tüübiks „O“, „F“, „W“ või „S“ siis on kohustuslik esitada hinnakordaja. Viies kokku seitsmest OTC andmeväljast.

Väärtpaperite arv, mis on ühe tuletislepingu objektiks.

Andmevälja XML tag	PriceMultiplier
Andmevälja formaat	Max19(d)
Andmevälja väärtused	[hinnakordaja]

4.7.12 [119] Täitmishind (T)

Kui tehingu objektiks oli OTC optsoonileping või *Warrant* ehk andmeväljal [116] on määratud tuletisinstrumenti tüübiks „O“ või „W“ siis on kohustuslik esitada täitmishind. Kuues kokku seitsmest OTC andmeväljast.

Andmevälja XML tag	StrikePrice
Andmevälja formaat	Max19(d)
Andmevälja väärtused	[täitmishind]

4.7.13 [120] Aegumise/väärtus-/täitmise kuupäev (T)

Kui tehingu objektiks oli OTC optsoonileping, futuur- või muu *forward*-leping, *Warrant* või *Swap* ehk andmeväljal [116] on määratud tuletisinstrumenti tüübiks „O“, „F“, „W“ või „S“ siis on kohustuslik esitada aegumise kuupäev. Viimane seitsmest OTC andmeväljast.

YYYY = aasta, MM = kuu, DD = päev

Andmevälja XML tag	ExpirationDate
Andmevälja formaat	10(x)
Andmevälja väärtused	ISO 8601 kuupäeva formaat (<i>Date Format</i>); YYYY-MM-DD

4.8 [121] Hind (K)

Ühe väärtpaperi hind, mis ei sisalda tehingutasu, arvestatud intressi või muid sarnaseid makseid. Nominaalse hinna korral kasutada välja „PriceCurrency“. Kui hind esitatakse protsendina, tuleb see 100-ga läbi korrutada ja kasutada kümnendike eraldajana punkti - näiteks 23,45% korral tuleb „PricePercentage“ väljale märkida 23.45 mitte 0,2345.

Andmevälja XML tag	PriceCurrency
Andmevälja formaat	Max19(d)
Andmevälja väärtused	[hind]

Andmevälja XML tag	PricePercentage
Andmevälja formaat	Max19(d)
Andmevälja väärtused	[hind]

4.9 [122] Hinna esitus (K)

Valuuta, milles väärtpaberi hind on väljendatud või võlakiri noteeritud.

Andmevälja XML tag	PriceNotation
Andmevälja formaat	3(a)
Andmevälja väärtused	[ISO 4217 järgi valuuta kood]

4.10 [123] Kogus (K)

Tehingu objektiks olnud väärtpaberite arv, tehingu võlakirjade nimiväärtuste summa või tuletisväärtpaberite arv.

Andmevälja XML tag	Quantity
Andmevälja formaat	Max19(d)
Andmevälja väärtused	[kogus]

4.11 [124] Vastaspole tunnus (K)

Kui vastaspolele on määratud BIC kood on selle kasutamine kohustuslik (kui kood on lühem kui 11 kohta tuleb lõppu lisada vastav arv „X”-e). Juhul kui vastaspolel ei ole BIC koodi või vastaspole ei ole teavitajale teada võib kasutada turu tunnuskoodi (MIC) või investeerimisühingu sisemist kliendikoodi (CUC). Kui vastav kood ei ole kättesaadav või esitatav, siis võib investeerimisühing esitada sisemiselt kasutatava tunnuse antud vastaspole suhtes.

Andmevälja XML tag	CounterpartyIdentificationBIC
Andmevälja formaat	11(x)
Andmevälja väärtused	ISO 9362 – SWIFT kood (Bank Identifier Code (BIC))

Andmevälja XML tag	CounterpartyIdentificationMIC
Andmevälja formaat	4(x)
Andmevälja väärtused	ISO 10383 – turu tunnuskood (Market Identifier Code (MIC))

Andmevälja XML tag	CounterpartyIdentificationCustomerInternal
Andmevälja formaat	Max40(x)
Andmevälja väärtused	[CUC]

4.12 [125] Kliendi tunnus (T)

Kui investeerimisühing teeb tehingu kliendi arvel ning kliendiks on BIC koodi omav investeerimisühing, siis on kohustuslik vastav kood esitada. Kui kliendil puudub BIC kood, siis tuleb kliendi tunnus koostada teavitaja enda BIC-koodi 8-st esimesest positsioonist (ka 11 kohalise BIC-i puhul) ja lisada sellele ilma tühikuta investeerimisühingu sisemine kliendikood (näiteks ABCDEE2X123456789). Kliendi tunnuse väli jääb tühjaks, kui klient on väärtpaberitehingu vastaspoleks või kui teavitaja teeb väärtpaberitehingu oma arvel ning klienti ei ole.

Andmevälja XML tag	ClientBIC
Andmevälja formaat	11(x)
Andmevälja väärtused	ISO 9362 – SWIFT kood (Bank Identifier Code (BIC))

Andmevälja XML tag	ClientInternal
Andmevälja formaat	Max40(x)
Andmevälja väärtused	[CUC]

4.13 [126] Täitmiskoha tunnus (K)

Reguleeritud turu või muu kauplemiskoha MIC (*Market Identifier Code*), süsteemse täitja puhul BIC ja turuvälise täitmise puhul väärtus „XOFF“.

Andmevälja XML tag	TradingVenueCodeBIC
Andmevälja formaat	11(x)
Andmevälja väärtused	ISO 9362 – SWIFT kood (Bank Identifier Code (BIC))

Andmevälja XML tag	TradingVenueCodeMIC
Andmevälja formaat	4(x)
Andmevälja väärtused	ISO 10383 – turu tunnuscode (Market Identifier Code (MIC))

Andmevälja XML tag	TradingVenueCodeXOFF
Andmevälja formaat	4(x) [XOFF]
Andmevälja väärtused	XOFF

4.14 [127] Tehingu viitenumber (K)

Unikaalne tehingu viitenumber, mille esitab teavitaja.

Andmevälja XML tag	TransactionReferenceNumber
Andmevälja formaat	Max40(x)
Andmevälja väärtused	[teingu viitenumber]

4.15 [128] Tühistamise tunnus (T)

Kui tegemist on tühistava teavitusega, siis peab väljal olema väärtus „C“

Andmevälja XML tag	CancelledTransactionFlag
Andmevälja formaat	1(a) [C]
Andmevälja väärtus	C

5 Lisad

5.1 XML aruannete vormindamine

Finantsinspeksioonile esitatavad aruandefailid vormindatakse XML-failidena mille struktuuri ja sisu määravad veebiaadressi <http://www.fi.ee/schemas2/1.3/> kaudu viidatavad XML-skeemid (vt ka <http://www.w3.org/XML/Schema>):

Faili nimi	Selgitus
TRS_DATTXN1.3.xsd	Tehinguteavituse dokumendi XML-skeem
TRS_TransactionRecordTypes1.3.xsd	Tehingu elemenditüübid
TRS_CancellationRecordTypes1.3.xsd	Tehingu tühistuse elemenditüübid
TRS_FDBTXN1.3.xsd	Tagasiside dokumendi XML-skeem
TRS_StandardDataTypes1.3.xsd	Standardsed elemenditüübid
TRS_ErrorsInfoTypes1.3.xsd	Veateate elemenditüübid

5.2 Aruannete krüptimine ja allkirjastamine

Aruanne peab olema krüpteeritud ja allkirjastatud, vastasel juhul seda töötlemisele ei võeta. Aruannete turvamiseks kasutatakse avaliku võtmega algoritme, mida realiseerivad OpenPGP standardit (<http://www.ietf.org/rfc/rfc2440.txt>) toetavad rakendused (nt PGP, GnuPG).

5.3 Võtmehaldus

5.3.1 Nõuded võtmetele

- Võtmepaari kasutajatunnuses peavad olema ära toodud ettevõtte kood, sõna ARUANDLUS, võtit kasutava töötaja nimi ja võtmepaari kehtivuse lõppkuupäev. FI kasutab ettevõtte (asutuse) koodina EPSTAT.
- Võtmepaarid kuuluvad regulaarsele muutmisele vähemalt üks kord kahe aasta jooksul.
- Kasutatud võtmepaarid tuleb säilitada, et oleks tagatud vahetatud andmete käideldavus.

5.3.2 Töökorraldus teavitusi edastavas ettevõttes

- Finantsinspeksiooniga andmevahetuse korraldamiseks määrab ettevõtte vastutava töötaja. Vastutav töötaja tagab ettevõtte võtmete ja vahetatud andmete käideldavuse.
- Vastutav töötaja korraldab vajaliku arvu võtmepaaride (ettevõtte aruandluse võtmepaarid) genereerimise, organiseerib nende kasutamise ettevõtte asjaosaliste töötajate poolt ja edastab avaliku(d) võtme(d) FI poolt määratud võtmehaldurile. Ettevõtte aruandluse võtmepaari isiklikku võtit kaitsvat paroolifraasi võib teada ainult kasutajatunnuses esitatud töötaja.
- Ettevõtte signeerib elektroonilisele edastusele kuuluvad andmed ettevõtte aruandluse isikliku võtmega, krüptib need FI avaliku võtmega ning edastab FI-le.
- Ettevõtte dekrüptib FI-lt elektroonilisel kujul saabunud andmed ning veendub nende autentsuses ja tervikluses.

5.3.3 Töökorraldus FI-s

- FI võtmehaldur tagab kasutatud võtmete ja vahetatud andmete käideldavuse.
- FI võtmehaldur genereerib võtmepaari (FI võtmepaar), organiseerib selle kasutamise FI-s ja edastab FI avaliku võtme ettevõtete vastutavatele töötajatele.
- FI võtmepaari isiklikku võtit kaitsvat paroolifraasi võib teada ainult võtmehaldur.
- FI dekrüptib teavitajatelt elektroonilisel kujul saabunud andmed ning veendub nende autentsuses ja tervikluses.
- Vajadusel FI signeerib elektroonilisele edastusele kuuluvad andmed FI isikliku võtmega, krüptib need ettevõtte aruandluse avaliku võtmega ning edastab ettevõttele.

5.3.4 Esmane võtmete vahetus

Ettevõtte vastutav töötaja ja FI võtmehaldur vahetavad avalikud võtmed elektrooniliselt. Võtmete terviklikkus ja autentsus tuvastatakse võtmete sõrmejälgede võrdlemise teel.

5.3.5 Edaspidine võtmete vahetus

Plaanilisel võtmevahetusel edastatakse uued avalikud võtmed elektrooniliselt, allkirjastades need eelnevalt kehtiva isikliku võtmega.

Eriolukordade puhul (isiklik võti on avalikustunud, kadunud või hävinenud) teavitatakse kohe juhtunust adressaate, genereeritakse uued võtmepaarid ning võtmete vahetuseks kasutatakse punktis 4 kirjeldatud skeemi.

Nii plaaniliste võtmevahetuste kui ka eriolukordade puhul kehtetuks muutunud võtmepaarid tuleb kasutusest kõrvaldada.

5.4 Aruandefailide edastamine

5.4.1 Aruandefailide edastamine

Allkirjastatud ja krüpteeritud aruandefail (või failid) edastatakse e-kirja manus(t)ena aadressile xml3@fi.ee.

Aruandefaili edastamiseks kasutatav e-kirja aadress ei tohi sisaldada numbreid.

Põhimõtteks on: 1 manus = 1 aruandefail = 1 XML-fail.

E-kiri peab olema MIME kodeeringus. Muud kodeeringud, nt Uucode, pole lubatud.

E-kirja teema-rida (*Subject*) ja keha (*Body*) ignoreeritakse.

Manuste arv pole piiratud, jälgida tuleb vaid häd tavaid e-kirja kogumahu osas.

Manusesse lisatava XML-faili pakkimine enne või pärast krüpteerimist ja allkirjastamist pole lubatud.

5.4.2 XML-automaadi vastused saabuvatele sõnumitele

XML-automaat saadab igale tehinguteavitusele vastuseks e-kirja, millele on lisatud allkirjastatud ja krüpteeritud tagasisidefail. E-kirja tekstiosas on tagasisidest ära toodud ainult konfidentsiaalseid andmeid mittesisaldav osa.

Tagasiside saatmiseks kasutab XML-automaat e-posti aadressi, mis on ära toodud tehinguteavituste aruandefaili atribuudis „ReplyTo“. Kui atribuut „ReplyTo“ on täitmata või pole loetav, kasutab XML-automaat sama atribuudi varasemast andmevahetusest andmebaasi salvestatud väärtust. Kui atribuudi „ReplyTo“ väärtust pole ka andmebaasis, kasutatakse tagasiside andmiseks e-kirja saatja aadressi.

5.4.3 Tagasiside veakoodid ja sisu

Tagasisidefaili veakoodid on toodud järgneval lehel toodud tabelis.

FINANTSINSPEKTSIOON

Veakood	Veateade (ingl)	Vea sisu
HUB-001	The file does not comply with the naming convention.	Faili nimekuju ei vasta nõuetele.
HUB-002	The source country code in the file name is different from the authority which has uploaded the file.	Faili edastaja aadress ja teavituskohuslase kood ei lange kokku.
HUB-005	The attached file type is incorrect or missing.	Aruandefail puudub.
FIL-001	The file wasn't encrypted or can't be decrypted.	Fail ei ole korrektselt krüpteeritud või dekrüpteerimine ebaõnnestus.
FIL-004	The signature is not recognized as a valid signature	Fail allkiri ei ole kehtiv.
FIL-006	The XML schema name can't be located.	XML-skeemi nime (versiooni) ei suudetud tuvastada.
FIL-007	The XML schema name is incorrect.	XML-skeemi nimi (versioon) on vale.
FIL-008	The file structure does not correspond to the XML scheme	Faili struktuur ei vasta XML-skeemile.
CON-001	This transaction record is a duplicate record.	Sama koodiga tehinguteavitus on juba esitatud.
CON-002	The ISIN code is invalid.	Instrumenti ISIN kood ei ole kehtiv.
CON-003	The trading venue MIC is invalid.	Täitmiskoha MIC kood on vale.
CON-004	The cancelled transaction record does not exist.	Tühistatavat tehinguteavitust ei ole andmebaasis.
CON-005	The trading date is in the future.	Tehingu kuupäev ei saa olla tulevikus.
CON-008	This transaction record has already been cancelled.	Tühistatav tehinguteavitus on juba tühistatud.
CON-009	The AII exchange code should be a valid MIC of an AII market.	MIC koodiga viidatud kauplemiskoha puhul ei kasutata AII-d. ⁵
CON-010	The AII put/call identifier field is incorrect	AII ostu- või müügioptsiooni tunnus on vale.
CON-011	The AII strike price is incorrect	AII täitmishind on vale.
CON-012	The reporting firm BIC is incorrect	Teavituskohuslase BIC kood ei ole kehtiv.
CON-013	The counterparty BIC is incorrect	Tehingu vastaspoole BIC kood ei ole kehtiv.
CON-014	The client BIC is incorrect	Kliendi BIC kood ei ole kehtiv.
CON-015	The trading venue BIC is incorrect	Täitmiskoha BIC kood ei ole kehtiv.
CON-016	The price notation is incorrect	Hinnanoteering on vale.
CON-017	The ISIN code of the ultimate underlying is invalid.	Alusvara ISIN kood ei ole kehtiv.
CON-018	The price multiplier is incorrect.	Hinnakordaja on vale.
CON-019	The strike price is incorrect	Täitmishind on vale.
CON-020	The expiration date is incorrect.	Lunastamise/väärtus-/täitmise kuupäev on vale.
CON-021	The market is not consistent with the instrument codification.	Kauplemiskoha ja tehingu instrumenti tunnused ei ühti.
CON-022	The classification of the instrument is not consistent with the currency code.	Tehingu instrumenti tunnused ja valuuta ei ühti.

⁵ AII identifikaatorit kasutavad reguleeritud turud on loetletud [MiFID andmebaasis](#).