

VÄÄRTPABERITEHINGUTEST FINANTSINSPEKTSIOONI TEAVITAMISE TEHNILISED TINGIMUSED

Finantsinspektsioon 2008

SISUKORD

1	ÜLDSÄTTED.....	4
1.1	Tehniliste tingimuste andmise alus.....	4
1.2	Tehniliste tingimuste eesmärk.....	4
2	TEAVITUSSÜSTEEMI OSAD, TEAVITAJATE LIIGID. NÄITED.....	5
2.1	Süsteemi osad.....	5
2.2	Süsteemi ülesehitus.....	5
2.2.1	Suur teavitaja.....	5
2.2.2	Väike teavitaja.....	5
2.3	Näited võimalikest teavituskohustuse stsenaariumitest.....	7
3	ANDMETEAVITUS JA -FORMAADID.....	13
3.1	Teavitajate andmed.....	13
3.2	Teavituse tüübid.....	13
3.2.1	[T] Uus teavitus.....	13
3.2.2	[C] Tühistav teavitus.....	13
3.2.3	[U] Muutev teavitus.....	13
3.3	Väljade kohustuslikkuse tasemed.....	13
3.4	Tehinguandmete formaat.....	14
4	ANDMEVÄLJAD: KOODID, FORMAADID JA VÄÄRTUSED.....	15
4.1	[101] Teavitaja nimi (T).....	15
4.2	[102] Teavitaja tunnus (K).....	15
4.3	[103] Väärtpaberitehingu kuupäev (K).....	15
4.4	[104] Väärtpaberitehingu kellaaeg (K).....	15
4.5	[105] Tehingu ostu või müügi märke (K).....	15
4.6	[106] Tehingu kliendi arvel või oma arvel (K).....	16
4.7	[107] Väärtpaberi nimetus (T).....	16
4.8	[108] Väärtpaberi tunnuse tüüp (K).....	16
4.9	[109] Väärtpaberi tunnus (K).....	16
4.10	[110] AII kauplemiskoha tunnus (T).....	17
4.11	[111] AII kauplemiskoha tootetunnus (T).....	17
4.12	[112] AII tuletisinstrumenti tüüp (T).....	17
4.13	[113] AII ostu- või müügioptioni tunnus (T).....	18
4.14	[114] AII lunastamise/väärtus-/täitmise kuupäev (T).....	18
4.15	[115] AII täitmishind (T).....	18
4.16	[116] Alusvara tunnuse tüüp (T).....	18
4.17	[117] Alusvara tunnus (T).....	19
4.18	[118] Hinnakordaja (T).....	19
4.19	[119] Hind (K).....	19
4.20	[120] Hinna esitus (K).....	20
4.21	[121] Kogus (K).....	20
4.22	[122] Koguse esitus (K).....	20
4.23	[123] Vastaspoole nimi või nimetus (T).....	20
4.24	[124] Vastaspoole tunnuse tüüp (K).....	20
4.25	[125] Vastaspoole tunnus (K).....	21
4.26	[126] Kliendi tunnus (T).....	21
4.27	[127] Kauplemiskoha tunnuse tüüp (K).....	21
4.28	[128] Kauplemiskoha tunnus (K).....	22
4.29	[129] Tehingu viitenumber (K).....	22
4.30	[130] Tühistamise/muutmise tunnus (K).....	22
5	Lisad.....	23
5.1	XML aruannete vormindamine.....	23
5.1.1	XML-dokumendina vormindatud aruande üldkirjeldus.....	23
5.1.2	Sõnumi päis.....	23

5.1.3	Aruanne	24
5.1.4	Aruande päis	24
5.1.5	Aruande rida	24
5.2	Aruannete krüptimine ja allkirjastamine	25
5.3	Võtmehaldus.....	25
5.4	Aruannete edastamine	26
5.4.1	Aruannete edastamine.....	26
5.4.2	XML automaadi vastused saabuvatele sõnumitele.....	26

1 ÜLDSÄTTED

1.1 Tehniliste tingimuste andmise alus

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

1.2 Tehniliste tingimuste eesmärk

Väärtpaberituru seaduse (VPTS) § 91 kohustab investeerimisühinguid teavitama Finantsinspektsiooni (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 sätestatud teavituse Finantsinspektsioonile elektrooniliselt XML-dokumendina edastamiseks.

2 TEAVITUSSÜSTEEMI OSAD, TEAVITAJATE LIIGID. NÄITED

2.1 Süsteemi osad

Tehingutest teavitamissüsteemi osad on järgmised:

- FI XML-automaat
 - FI XML-automaadi teavitajate haldus;
 - 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 piisava ajavaruga käesoleva teavitamissüsteemi spetsifikatsiooni, 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 aruannetest koondfaili. Koondfail on XML-formaadis tehingukirjete kogum, mis on koostatud süsteemi spetsifikatsioonis esitatud andmeväljade kirjelduste alusel. Nimetatud andmeväljade kirjeldus on ühine suurele ja väiksele teavitajale.

Koostatud koondfail edastatakse e-kirja manusena 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 suurtel teavitajatel luua API juurde esitatud tehingute salvestamiseks ja säilitamiseks andmebaas, mis lihtsustab vigaste andmete parandamist ja taasesitamist.

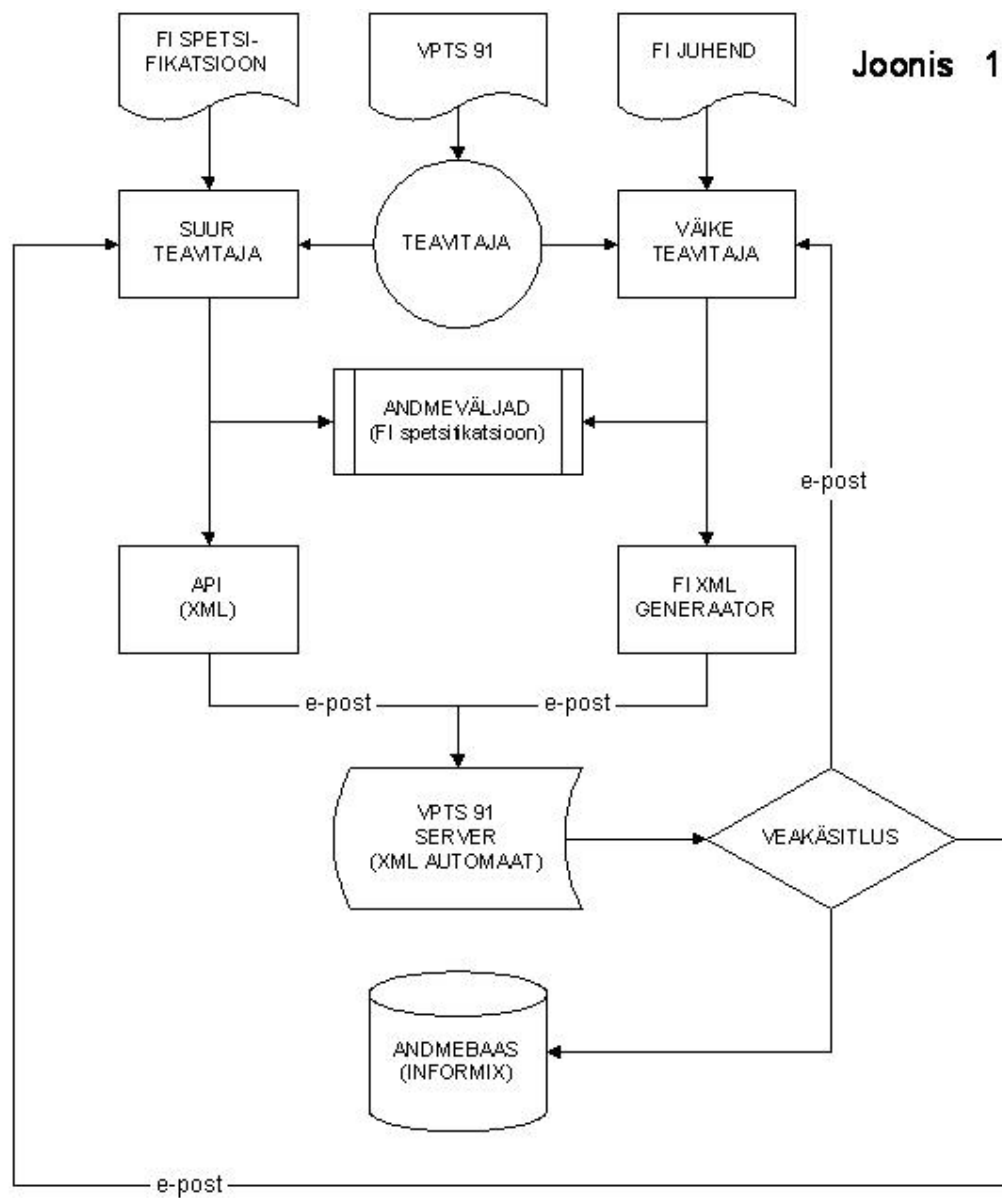
2.2.2 Väike teavitaja

Väike teavitaja saab Finantsinspektsioonilt väikesemahulisteks teavitamiseks eelkoostatud struktuuriga Microsoft Exceli formaadis faili – XML-generaatori. Nimetatud failis on andmeväljad teavitaja püsiandmete ning tehinguandmete sisestamiseks. Finantsinspektsioon koostab XML-generaatori faili täitmise hõlbustamiseks juhendi. Kõnealused failid saavad olema allalaetavad Finantsinspektsiooni kodulehelt.

Väike teavitaja peab XML-generaatori abil loodud XML-formaadis andmefaili ehk nn koondfaili 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.

Finantsinspektsioon soovib väikesel teavitajal salvestada iga XML-generaatori abil loodud XML-formaadis andmefail failisüsteemis iseseisva nimega (nt kasutada faili nimes failide eristamiseks saatmise kuupäeva).

Joonis 1

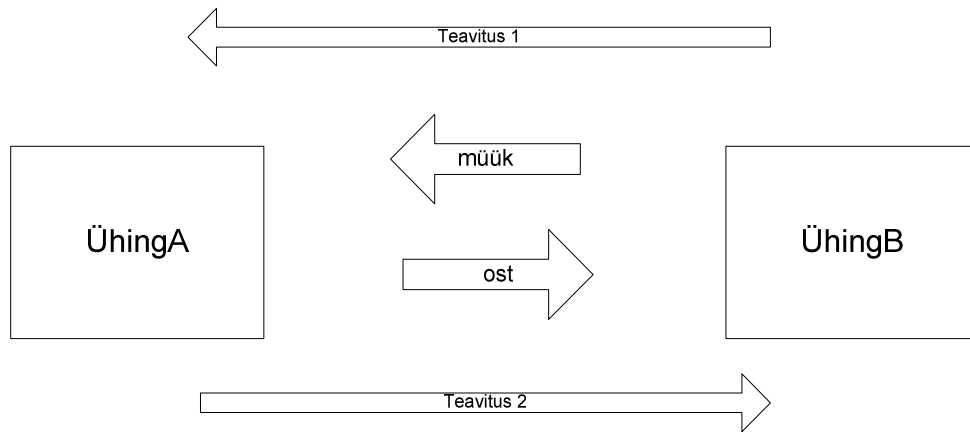


2.3 Näited võimalikest teavituskohustuse stsenaariumitest

Näites esitatakse vaid vastavat punkti puudutavad väljad.

Näide 1

Tehingu tingimused: Turuväline tehing
 InvesteerimisühingA ostab väärtpabereid
 InvesteerimisühingB müüb väärtpabereid.
 Mõlemad investeerimisühingud tegutsevad oma arvel



Välja nimetus	Tehingu teavitus 2	Tehingu teavitus 1
102 Teavitaja tunnus	InvesteerimisühingA = (BIC)	InvesteerimisühingB (BIC)
105 Tehingu ostu või müügi märke	Ost = (B)	Müük = (S)
106 Tehing kliendi arvel või oma arvel	Oma arvel = (P)	Oma arvel = (P)
124 Vastaspoole tunnuse tüüp	BIC	BIC
125 Vastaspoole tunnus	InvesteerimisühingB= (BIC)	InvesteerimisühingA= (BIC)
126 Kliendi tunnus	-	-
127 Kauplemiskoha tunnuse tüüp	XOFF	XOFF
128 Kauplemiskoha tunnus	XOFF	XOFF

Näide 2

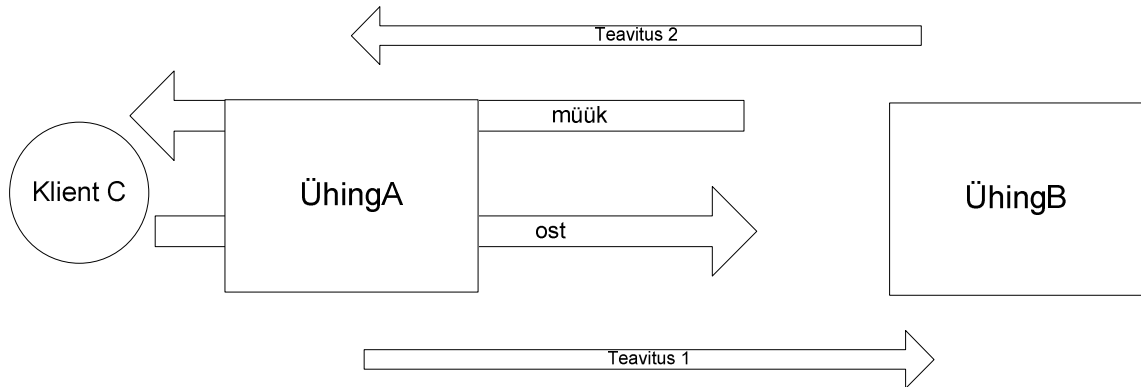
Tehingu tingimused:

Turuväline tehing

KlientC ostab väärtpabereid

InvesteerimisühingA vahendab tehingut, tegutsedes KlientC
agendina

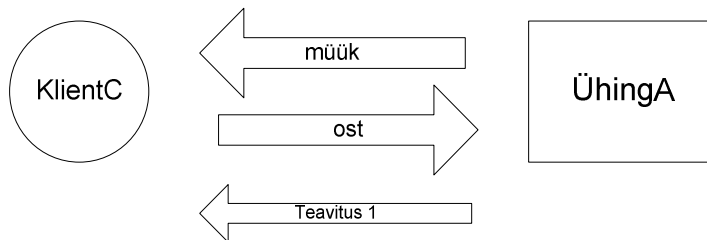
InvesteerimisühingB müüb väärtpabereid



Välja nimetus	Tehingu teavitus 1	Tehingu teavitus 2
102 Teavitaja tunnus	InvesteerimisühingA	InvesteerimisühingB
105 Tehingu ostu või müügi märke	Ost	Müük
106 Tehing kliendi arvel või oma arvel	Kliendi arvel	Oma arvel
124 Vastaspole tunnuse tüüp	BIC	BIC
125 Vastaspole tunnus	InvesteerimisühingB	InvesteerimisühingA
126 Kliendi tunnus	KlientC	-
127 Kauplemiskoha tunnuse tüüp	XOFF	XOFF
128 Kauplemiskoha tunnus	XOFF	XOFF

Näide 3

Tehingu tingimused: Turuväline tehing
 KlientC ostab väärpabereid
 InvesteerimisühingA müüb väärpabereid



Välja nimetus	Tehingu teavitus
102 Teavitaja tunnus	InvesteerimisühingA
105 Tehingu ostu või müügi märg	Müük
106 Tehing kliendi arvel või oma arvel	Oma arvel
124 Vastaspoole tunnuse tüüp	CUC
125 Vastaspoole tunnus	KlientC
126 Kliendi tunnus	
127 Kauplemiskoha tunnuse tüüp	XOFF
128 Kauplemiskoha tunnus	XOFF

Näide 4

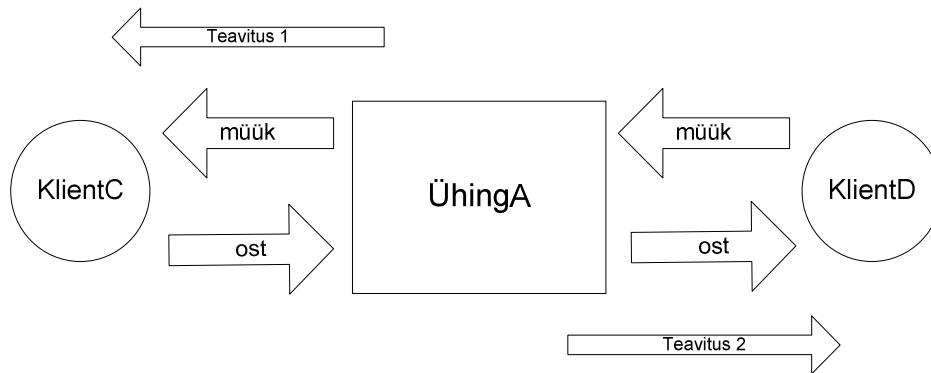
Tehingu tingimused:

Turuväline tehing

KlientC ostab väärtpabereid

InvesteerimisühingA tegutsedes oma arvel müüb KlientC-le
ja ostab KlientD-lt

KlientD müüb väärtpabereid.



Välja nimetus	Tehingu teavitus 1	Tehingu teavitus 2
102 Teavitaja tunnus	InvesteerimisühingA	InvesteerimisühingA
105 Tehingu ostu või müügi märg	Müük	Ost
106 Tehing kliendi arvel või oma arvel	Oma arvel	Oma arvel
124 Vastaspole tunnuse tüüp	CUC	CUC
125 Vastaspole tunnus	KlientC	KlientD
126 Kliendi tunnus	-	-
127 Kauplemiskoha tunnuse tüüp	XOFF	XOFF
128 Kauplemiskoha tunnus	XOFF	XOFF

Näide 5

Tehingu tingimused:

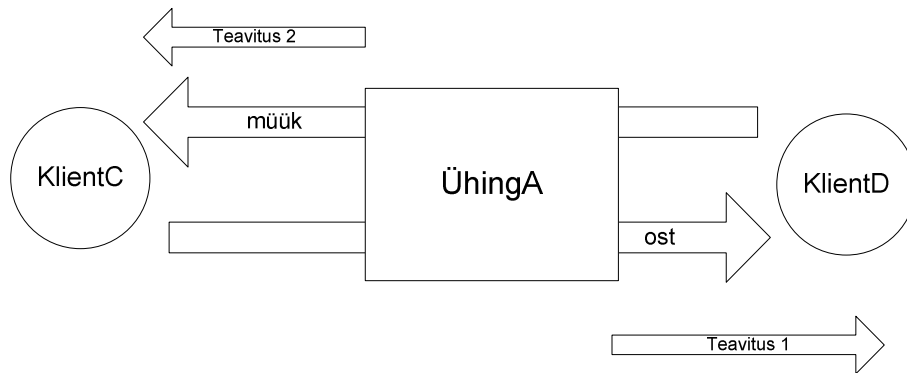
Turuväline tehing

KlientC ostab väärtpabereid

KlientD müüb väärtpabereid

InvesteerimisühingA vahendab tehingut tegutsedes KlientC arvel ostab väärtpaberid KlientD-lt.

InvesteerimisühingA vahendab tehingut tegutsedes KlientD arvel müüb väärtpaberid KlientC-le.



Välja nimetus	Tehingu teavitus 1	Tehingu teavitus 2
102 Teavitaja tunnus	InvesteerimisühingA	InvesteerimisühingA
105 Tehingu ostu või müügi märke	Müük	Ost
106 Tehing kliendi arvel või oma arvel	Kliendi arvel	Kliendi arvel
124 Vastaspoole tunnuse tüüp	CUC	CUC
125 Vastaspoole tunnus	KlientC	KlientD
126 Kliendi tunnus	KlientD	KlientC
127 Kauplemiskoha tunnuse tüüp	XOFF	XOFF
128 Kauplemiskoha tunnus	XOFF	XOFF

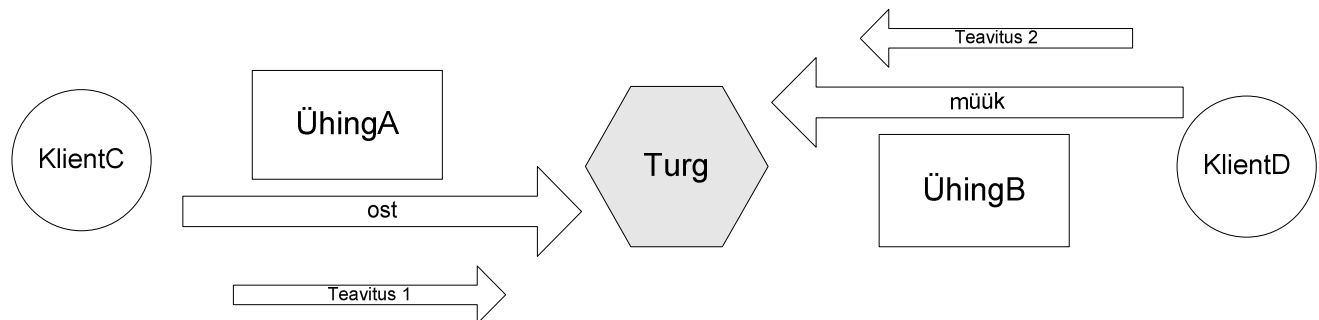
Näide 6

Tehingu tingimused:

Turutehing:

KlientC ostab väärtpabereid,
 InvesteerimisühingA tegutsedes KlientC arvel ostab
 väärtpaberid turult.

KlientD müüb väärtpabereid,
 InvesteerimisühingB tegutsedes KlientD arvel müüb
 väärtpaberid turule.



Välja nimetus	Tehingu teavitus 1	Tehingu teavitus 2
102 Teavitaja tunnus	InvesteerimisühingA	InvesteerimisühingB
105 Tehingu ostu või müügi märg	Ost	Müük
106 Tehing kliendi arvel või oma arvel	Kliendi arvel	Kliendi arvel
124 Vastaspole tunnuse tüüp	-	-
125 Vastaspole tunnus	-	-
126 Kliendi tunnus	KlientC	KlientD
127 Kauplemiskoha tunnuse tüüp	MIC	MIC
128 Kauplemiskoha tunnus	Kauplemiskoha MIC kood	Kauplemiskoha MIC kood

3 ANDMETEAVITUS JA -FORMAADID

3.1 Teavitajate andmed

Investeeringisühingud määravad enda sees teavituste eest vastutava(d) isiku(d) (näiteks projektijuht, IT spetsialist) ja teatavad 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 andmepakettide saatmiseks ning veareportite vastuvõtmiseks.

3.2 Teavituse tüübid

Esitavad teavitused saavad olla kolme tüüpi: 1) uus, 2) tühistav ja 3) muutev.

3.2.1 [T] Uus teavitus

Teavituse tüübi tunnus „T” tähistab uut teavitust.

Arvesse tuleb võtta väljade kohustuslikkuse tasemeid.

Uue teavituse puhul väli [130] Tühistamise/muutmise tunnus = „T”

3.2.2 [C] Tühistav teavitus

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

Arvesse tuleb võtta väljade kohustuslikkuse tasemeid.

Tühistava teavituse puhul väli [130] Tühistamise/muutmise tunnus = „C”

Tühistav teavitus tühistab eelnevalt saadetud teavituse.

3.2.3 [U] Muutev teavitus

Teavituse tüübi tunnus „U” tähistab muutvat teavitust (*updated transaction report*).

Arvesse tuleb võtta väljade kohustuslikkuse tasemeid.

Muutva teavituse puhul väli [130] Tühistamise/muutmise tunnus = „U”

Muutev teavitus asendab eelnevalt saadetud 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

Tehingute raporteerimisel 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*):
 - arv peab sisaldama vähemalt 1 numbrit;
 - kümnendikega arv peab sisaldama vähemalt 1 numbrit enne kümnendikke eraldavat märki; kümnendikke eraldav märk on punkt „.”;
 - arvudes ei kasutata tühikuid ega tuhandikke eraldavaid märke;
 - määrad esitatakse protsentides, nt väärtus 23.45 esindab 23.45% protsenti;
 - maksimaalne murdosa täpsus: 5 numbrit;
 - 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:
 - Muutuva pikkusega väljad on esitatud prefiksiga „Max”, millele järgneb maksimaalse välja pikkuse väärtus. Näiteks Max19(d) tähistab maksimaalselt 19 numbrist koosnevat arvu kuhu hulka on arvestatud ka märk + või -.
 - n(n), n(a), n(d) ja n(x) on muutuva pikkusega väljad, kuid mitte üle määratud välja pikkuse väärtuse.

4 ANDMEVÄLJAD: KOODID, FORMAADID JA VÄÄRTUSED

4.1 [101] Teavitaja nimi (T)

Investeeringisühingu ärinimi suurtähtedega.

Andmevälja XML tag	ReportingFirmName
Andmevälja formaat	Max70(x)
Andmevälja väärtused	[teavitaja nimi]

4.2 [102] Teavitaja tunnus (K)

Eestis registreeritud investeeringisühingu või välisriigi investeeringisühingu Eesti filiaali ISO 9362 kood ehk BIC (*Bank Identifier Code*) ehk SWIFT kood.

Koodi pikkus on kas 8 või 11 positsiooni. Kui koodi pikkus on 8 positsiooni, tuleb koodi lõppu lisada XXX.

Kui investeeringisühingut esindab teavitamisel kolmas isik, siis näidatakse teavitamisel investeeringisühingu BIC.

Andmevälja XML tag	ReportingFirmIdentification
Andmevälja formaat	11(x)
Andmevälja väärtused	[teavitaja tunnus]

4.3 [103] Väärtpaberitehingu kuupäev (K)

Kuupäev, millal tehing tehti.

YYYY = aasta, MM = kuu, DD = päev

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

4.4 [104] Väärtpaberitehingu kellaaeg (K)

Kellaaeg esitatakse näidates ära tunnid, minutid ja sekundid, millal tehing tehti. Kellaaja arvestamisel lähtutakse Eesti ajast.

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

4.5 [105] Tehingu ostu või müügi märged (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>)

4.6 [106] 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>)

4.7 [107] Väärtpaberi nimetus (T)

Väärtpaberi nimetus või börsikauplemise lühikood (*ticker*) suurtähtedega.

Andmevälja XML tag	InstrumentName
Andmevälja formaat	Max70(x)
Andmevälja väärtused	[väärtpaberi nimetus]

4.8 [108] Väärtpaberi tunnuse tüüp (K)

Väli “väärtpaberi tunnuse tüüp” määrab koodide kaudu välja “väärtpaberi tunnus” [109] tüübi.

Andmevälja XML tag	InstrumentSecurityCodeType
Andmevälja formaat	Max3(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definitsioon
IS	Rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber ISO 6166 – <i>International Securities Identification Number (ISIN)</i>
AII	Alternatiivne identifikaator (<i>Alternative Instrument Identifier</i>) koosneb kuuest AII andmeväljast. Kasutatakse kui väärtpaberile ei ole ISIN koodi omistatud.

4.9 [109] Väärtpaberi tunnus (K)

Väärtpaberile või tuletisväärtpaberile omastatud eristatav tunnuskood. Kasutamiseks on kohustuslik ISIN kood. Juhul kui tegemist on Euroopa Majanduspiirkonna lepinguriigi reguleeritud turule kauplemiseks võetud väärtpaberiga või tuletisinstrumendiga ning sellele ei ole omistatud ISIN koodi, on kohustuslik kasutada alternatiivset identifikaatorit AII.

Andmevälja XML tag	InstrumentIdentification
Andmevälja formaat 1)	2(a)9(x)1(n)
Andmevälja formaat 2)	6 AII andmevälja
Andmevälja väärtused	Vaata järgmist tabelit...

Andmevälja formaat	Andmevälja väärtused
2(a)9(x)1(n)	[Kui Väärtpaberi tunnuse tüüp = IS]
6 AII andmevälja	[Kui Väärtpaberi tunnuse tüüp = AII]

4.10 [110] AII kauplemisskoha tunnus (T)

Esitamine kohustuslik, kui väljal [109] ei esitatud ISIN koodi. Esimene kuuest AII andmeväljast, mida kasutatakse väärtpaberite või tuletisinstrumentide puhul, millele ei ole omistatud ISIN koodi.

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

4.11 [111] AII kauplemisskoha tootetunnus (T)

Esitamine kohustuslik, kui väljal [109] ei esitatud ISIN koodi. Teine kuuest AII andmeväljast, mida kasutatakse väärtpaberite või tuletisinstrumentide puhul, millele ei ole omistatud ISIN koodi.

Tehingu objektiks olevale tuletisinstrumentidele või väärtpaberile kauplemisskoha poolt omistatud tunnuskood, mis on unikaalne ning tuletatud alusvarast, arveldamise tüübist ja muudest instrumendile iseloomulikest tunnustest lähtuvalt.

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

4.12 [112] AII tuletisinstrumenti tüüp (T)

Esitamine kohustuslik, kui väljal [109] ei esitatud ISIN koodi. Kolmas kuuest AII andmeväljast, mida kasutatakse väärtpaberite või tuletisinstrumentide puhul, millele ei ole omistatud ISIN koodi.

Antud andmevälja abil määratakse ära, kas tehingu objektiks oli optsiooni- või futuurleping.

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

Kood	Definitsioon
O	Opsioonileping
F	Futuurleping

4.13 [113] AII ostu- või müügioptsiooni tunnus (T)

Esitamine kohustuslik, kui väljal [109] ei esitatud ISIN koodi. Neljas kuuest AII andmeväljast, mida kasutatakse väärtpaberite või tuletisinstrumentide puhul, millele ei ole omistatud ISIN koodi.

Näidatakse, kas tegu on ostu- või müügioptsiooniga. Juhul kui andmeväljal [112] 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

4.14 [114] AII lunastamise/väärtus-/täitmise kuupäev (T)

Esitamine kohustuslik, kui väljal [109] ei esitatud ISIN koodi. Viies kuuest AII andmeväljast, mida kasutatakse väärtpaberite või tuletisinstrumentide puhul, millele ei ole omistatud ISIN koodi.

Võlakirja lunastamise kuupäev, tuletisväärtpaberi väärtus- või täitmise kuupäev.

YYYY = aasta, MM = kuu, DD = päev

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

4.15 [115] AII täitmishind (T)

Esitamine kohustuslik, kui väljal [109] ei esitatud ISIN koodi. Viimane kuuest AII andmeväljast, mida kasutatakse väärtpaberite või tuletisinstrumentide puhul, millele ei ole omistatud ISIN koodi.

Opsiooni täitmishind, mille puhul kümnendike eraldamiseks kasutatakse punkti „.”. Futuuri puhul täitmishind puudub, ning andmevälja väärtuseks tuleb määrata „0”.

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

4.16 [116] Alusvara tunnuse tüüp (T)

Väli “alusvara tunnuse tüüp” määrab koodide kaudu “alusvara tunnuse” [117] tüübi. Kui alusvarale on omistatud ISIN kood, siis on kohustuslik andmeväljal märkida „IS”, kõikidel muudel juhtudel „OT”.

Andmevälja XML tag	UnderlyingInstrumentSecurityCodeType
Andmevälja formaat	2(a)
Andmevälja väärtused	Koodid...

Kood	Definitsioon
IS	Alusvaraks rahvusvahelise väärtpaberite identifitseerimisnumbriga väärtpaber ISO 6166 – <i>International Securities Identification Number (ISIN)</i>
OT	Muul alusvaral põhinevad tuletisinstrumentid (<i>Commodity, Index Rate, Index</i> jne)

4.17 [117] Alusvara tunnus (T)

Kui alusvarale on omistatud ISIN kood, siis märkida andmeväljal vastav ISIN, ülejäänud juhtudel määrata tuletisinstrumenti tüüp vastavalt alusvarale.

Andmevälja XML tag	UnderlyingInstrumentType
Andmevälja formaat 1)	2(a)9(x)1(n)
Andmevälja formaat 2)	1(a)
Andmevälja väärtused	Vaata järgmist tabelit...

Andmevälja formaat	Andmevälja väärtused
2(a)9(x)1(n)	[Kui Alusvara tunnuse tüüp = IS]
1(a)	[Kui Alusvara tunnuse tüüp = OT] Koodid...

Kood	Definitsioon
Q	Aktsiatuletisinstrument (<i>Equity Derivative</i>)
O	Võlakirjatuletisinstrument (<i>Bond Derivative</i>)
C	Kaubatuletisinstrument (<i>Commodity Derivative</i>)
F	Valuutatuletisinstrument (<i>Currency Derivative</i>)
I	Intressimäära tuletisinstrument (<i>Index Rate Derivative</i>)
X	Indekstuletisinstrument (<i>Index Derivative</i>)
N	Muud (<i>Others</i>)

4.18 [118] Hinnakordaja (T)

Väärtpaberite arv, mis võib olla ühe tehingu objektiks (*lot*).

Andmevälja XML tag	PriceMultiplier
Andmevälja formaat	Max19(d)
Andmevälja väärtused	[hinnakordaja] (vaikimisi väärtus "1")

4.19 [119] Hind (K)

Ühe väärtpaberi hind, mis ei sisalda tehingutasu, arvestatud intressi või muid sarnaseid makseid. Kui hind esitatakse protsendina, tuleb see 100-ga läbikorrutada ja kasutada kümnendike eraldajana punkti - näiteks 23,45% korral tuleb hinna väljale märkida 23.45 mitte 0,2345.

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

4.20 [120] 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]

4.21 [121] 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]

4.22 [122] Koguse esitus (K)

Koguse tunnuseks näidatakse, kas kogus on väljendatud väärtpaberite arvuna, võlakirjade nimiväärtusena või tuletisväärtpaberite arvuna.

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

Kood	Definitsioon
F	Kogus, mis on esitatud väärtpaberite arvuna
B	Kogus, mis on esitatud võlakirjade nimiväärtusena
D	Kogus, mis on esitatud tuletisväärtpaberite arvuna

4.23 [123] Vastaspole nimi või nimetus (T)

Tehingu vastaspole täielik nimi või nimetus.

Andmevälja XML tag	CounterPartyName
Andmevälja formaat	Max70(x)
Andmevälja väärtused	[vastaspole nimi]

4.24 [124] Vastaspole tunnuse tüüp (K)

Väli "vastaspole tunnuse tüüp" määrab koodide kaudu välja "vastaspole tunnus" [125] tüübi.

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

Kood	Definitsioon
BIC	ISO 9362 – SWIFT/ <i>Bank Identifier Code</i>
IBEI	ISO 16372 – rahvusvaheline äriregistri reg. kood (<i>International Business Entity Identifier</i>)
MIC	ISO 10383 – turu tunnuskood (<i>Market Identifier Code (MIC)</i>) Kasutada turutehingu korral, kui vastaspoolt pole võimalik määrata.
CUC	Kliendikood (<i>Customer/Client</i>)

4.25 [125] Vastaspole tunnus (K)

Kui vastaspolele on määratud BIC kood või turu tunnuskood MIC on selle kasutamine kohustuslik. Juhul kui vastaspolele ei ole määratud eelnevaid koode võib kasutada rahvusvahelist äriregistri koodi (IBEI) või näidata investeerimisühingu sisemist tunnust antud vastaspole suhtes (CUC), lisades selle ilma tühikuta teavitaja enda BIC-koodi 8 esimese positsiooni järele (näiteks ABCDEE2X123456789).

Andmevälja XML tag	CounterParty
Andmevälja formaat 1) BIC	11(x)
Andmevälja formaat 2) IBEI	2(a)7(x)1(n)
Andmevälja formaat 3) MIC	4(x)
Andmevälja formaat 4) CUC	Max40(x)
Andmevälja väärtused	[BIC], [IBEI], [MIC], [CUC]

4.26 [126] 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 ja klienti ei ole.

Andmevälja XML tag	Client
Andmevälja formaat 1) BIC	11(x)
Andmevälja formaat 1) CUC	Max40(x)
Andmevälja väärtused	[BIC], [CUC]

4.27 [127] Kauplemiskoha tunnuse tüüp (K)

Väli “kauplemiskoha tunnuse tüüp” määrab koodide kaudu “kauplemiskoha tunnuse” [128] tüübi.

BIC kood märgitakse süsteemse täitja puhul.

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

Kood	Definitsioon
BIC	ISO 9362 järgi SWIFT/ <i>Bank Identifier Code</i>
MIC	ISO 10383 järgi kauplemiskoha identifitseerimiskood (<i>Market Identifier Code (MIC)</i>)
XOFF	Tehing on tehtud turuväliselt (<i>Off-exchange</i>)

4.28 [128] Kauplemiskoha tunnus (K)

Reguleeritud turu või muu kauplemiskoha MIC (*Market Identifier Code*) või süsteemse täitja puhul BIC.

Andmevälja XML tag	TradingVenueCode
Andmevälja formaat 1) BIC	11(x)
Andmevälja formaat 2) MIC	4(x)
Andmevälja formaat 3) XOFF	4(x) [XOFF]
Andmevälja väärtused	[MIC], [BIC], [XOFF]

4.29 [129] Tehingu viitenumber (K)

Unikaalne tehingu viitenumber, mille esitab teavitaja.

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

4.30 [130] Tühistamise/muutmise tunnus (K)

Vastavalt tunnuse koodile määratakse ära, kas tegemist on uue, tühistava või muutva teavitusega.

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

Kood	Definitsioon
T	Uus tehinguteavitus (<i>Transaction</i>)
C	Tühistav tehinguteavitus (<i>Cancellation</i>)
U	Muutev tehinguteavitus (<i>Update</i>)

5 Lisad

5.1 XML aruannete vormindamine

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

5.1.1 XML-dokumendina vormindatud aruande üldkirjeldus

Loogiliselt on aruanne koos seda kirjeldava infoga (nn päis) esitatav sõnumina, mille üldine kuju on järgmine:

```
<message>
  <message_header>
    ...
  </message_header>
  <report>
    <report_header>
      ...
    </report_header>
    <row>
      ...
    </row>
  </report>
</message>
```

5.1.2 Sõnumi päis

Element	XML element	Kohustuslik
Sõnumi päis	message_header	Jah
Finantsasutuse kood	from	Jah
Sõnumi loomise hetk	date	Jah
Edastaja nimi	sender	Jah
Edastaja e-mail	send_mail	Jah
Edastaja telefon	send_phone	Ei
Kommentaar	comment	Ei
Sõnumile vastuse nõue	require_receipt	Jah

Näide:

```
<message_header>
  <from>765</from>
  <date>2001-10-10T11:20:23</date>
  <sender>Jaan Kask</sender>
  <send_mail>jaan.kask@domeen.ee</send_mail>
  <send_phone>6666666</send_phone>
  <require_receipt>yes</require_receipt>
</message_header>
```

Kuna teavitaja vastutab aruannete saatmise eest ning kuna hetke seisuga on ainuke automatiseeritud viis aruande (mitte)kohalejõudmise kohta Finantsinspeksioonilt tagasiside saamiseks „Sõnumile vastuse nõue“, peab sellele väljale olema omistatud väärtus „yes“. Teavitaja saab aruande saadetuks lugeda üksnes juhul kui Finantsinspeksioonilt on temani jõudnud peatükis 5.4.3 kirjeldatud positiivne tagasiside. Kui Finantsinspeksioonilt ei saabu

e-kirja veatea(de)te või saadetise töötlusse võtmise teatega, tuleb teavitajal võtta telefoni või e-posti teel ühendust Finantsinspektsioonis tehingute aruandluse eest vastutava ametnikuga.

5.1.3 Aruanne

```
<report>
  <report_header>
    ...
  </report_header>
  <row>
    ...
  </row>
  <row>
    ...
  </row>
</report>
```

5.1.4 Aruande päis

Element	XML element	Kohustuslik
Aruande päis	report_header	Jah
Aruande kood	typeid	Jah
Aruande kuupäev	timeid	Jah
Aruande koostaja nimi	compiler	Jah
Aruande koostaja e-mail	comp_mail	Jah
Aruande koostaja telefon	comp_phone	Jah

Näide:

```
<report_header>
  <typeid>162</typeid>
  <timeid>2001-09-30</timeid>
  <compiler>Jelizaveta Ivanova</compiler>
  <comp_mail>liza@domeen.ee</comp_mail>
  <comp_phone>7777777</comp_phone>
</report_header>
```

Väli „Aruande kuupäev“ näitab, millise kuupäeva tehingute andmeid (T-tüüpi teavitusi) aruanne sisaldab.

Lisaks T-tüüpi teavitustele võib aruanne sisaldada ükskõik mis kuupäeva U- ja C-tüüpi teavitusi.

Kui mõne T-tüüpi teavituse andmed selguvad tagantjärele, tuleb vastava kuupäeva aruanne uuesti saata, lisades sinna täiendavad T-tüüpi teavitused.

5.1.5 Aruande rida

Element	XML element	Kohustuslik
Aruanderida	row	Jah
Rea 1. element	Vastavalt andmeväljade skeemile	Jah
Rea 2. element	Vastavalt andmeväljade skeemile	Jah
...	...	...

Näide:


```

<row>
    <ReportingPartyName>ABC INVESTEERINGUD</ReportingPartyName>
    <ReportingFirmIdentification>765</ReportingFirmIdentification>
    ...
</row>

```

5.2 Aruannete krüptimine ja allkirjastamine

Aruanne peab olema krüptitud 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 aruandeid 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 Aruannete edastamine

5.4.1 Aruannete edastamine

Allkirjastatud ja krüptitud aruanne (või aruanded) edastatakse e-kirja manus(t)ena aadressile xml3@fi.ee.

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

Põhimõtteks on: 1 manus = 1 aruanne = 1 XML-dokument.

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 häid tavasid e-kirja kogumahu osas.

Manusesse lisatava XML-dokumendi pakkimine enne või pärast krüptimist ja allkirjastamist pole lubatud.

5.4.2 XML automaadi vastused saabuvatele sõnumitele

Korrektse sõnumi saabumisel saadab XML-automaat saatjale tagasisidet vaid juhul, kui elemendi <require_receipt> väärtuseks oli „yes“. Sel juhul saab saatja teate, mis kinnitab, et saabunud aruanne (nimetatakse manusena edastatud faili nime) on võetud töötlusse.

Vigase aruande korral edastatakse vastavale saatja poolt määratud adressaadile veateated.

Sõnumi päises esitatud aadressile edastatakse üldisemad vead, aruande päises esitatud aadressile edastatakse aruandeosa puudutavad vead.

Esineb ka olukordi kus vigasid on võimalik edastada vaid sõnumi tegelikule saatjale (või kindlale teadaolevale aadressile).

Juhul kui elemendi <comment> väärtus pole tühi, edastab XML-automaat selles sisalduva teate vastava ettevõtte tehingute aruandluse töötlejale FI-s.