



MUUDATUSED SEOSSES VÄÄRTPABERITEHINGUTEST FINANTSINSPEKTSIOONI TEAVITAMISEGA

Väärtpaberituru seaduse („VPTS”) § 91 lõikest 1 tulenevalt on investeerimisühingud¹ kohustatud teavitama Finantsinspeksiooni kõigist reguleeritud turule kauplemiseks võetud väärtpaberitega tehtud tehingutest. Esitatud tehinguandmeid töödeldakse, säilitatakse ja edastatakse teiste liiduriikide finantsjärelevalve asutustele Finantsinspeksiooni poolt loodud ja hallatava Tehingutest Raporteerimise Süsteemi (TRS) abil ning neid kasutatakse finantsjärelevalve asutuste poolt väärtpaberiturul osalejate turukäitumise analüüsimiseks ning turukuritarvituste tuvastamiseks.

Tehingutest teavitamise tehniliste tingimuste dokument on kehtestatud VPTS § 91 lõike 8, rahandusministri 14.07.2007 määruse nr 52 „Väärtpaberitehingutest Finantsinspeksiooni teavitamise kord” § 2 lõike 2 ja Euroopa Komisjoni otsekohalduva määruse (EÜ) nr 1287/2006 art 12 punktide 1. ja 2. ning art 13 punkti 1. alusel ning on kättesaadav Finantsinspeksiooni koduleheküljel <http://www.fi.ee/index.php?id=2897>. Seoses Euroopa Väärtpaberituru Järelevalveasutuste Komitee (CESR) poolt tehinguteavituste süsteemi arendamisega muudeti 03.11.2008 jõustunud rahandusministri määrusega ka kohaliku teavitussüsteemi TRS andmeväljade struktuuri ja teavitamise tehnilisi tingimusi.

Käesoleva dokumendi eesmärk on alustada konsultatsioone Eesti turuosalistega seoses kohaliku teavitussüsteemi TRS täiendavate tehniliste funktsionaalsuste lisamiseks ja olemasolevate arendamiseks. Muudatuste peamiseks ajendiks on andmekvaliteedi tõstmine läbi automaatse tagasiside ning turuväliste (OTC) tuletisinstrumentidega seotud tehingutest teavitamise võimaldamine.

Teavituskorda puudutava rahandusministri määruse muutmiseks alustab Finantsinspeksioon konsultatsioone ka Rahandusministeeriumiga.

¹ Investeerimisteenusel osutavad investeerimisühingud, krediitiasutused ja fondivalitsejad.



ETTEPANEKUD MUUDATUSTEKS

Teavitamiskorda ja sellega seotud infotehnoloogilisi süsteeme puudutavad muudatused on esialgse ajakava kohaselt plaanis rakendada 05.09.2011. Eelistatud on ühekordne ja üldine kõiki turuosalisi hõlmav üleminek selmet rakendada üleminekuperioodi.

Järgnevalt on toodud kohalikku teavitamiskorda ning TRS-i puudutavad Finantsinspeksiooni poolsed muudatusettepanekud:

Automaatne vigade tuvastus ja tagasiside

Rahandusministri määruse § 3 lõige 1 kohustab Finantsinspeksioon kontrollima viivitatamatult aruande vastavust määruses sätestatud nõuetele ning puuduste leidmisel informeerima viivitatamatult sellest teavitajat. Mainitud nõude tõhusamaks täitmiseks lisatakse TRS-ile automaatne vigade tuvastamise ja tagaside genereerimise funktsionaalsus. Sisuliselt tähendab see täidetud andmeväljade võrdlust konkreetse välja jaoks defineeritud andmeformaadile.

Vigade tuvastamisel genereerib süsteem automaatse XML formaadis vastussõnumi, krüpteerib selle ning saadab eelnevalt defineeritud e-posti aadressi(de)le. Võimalikud veateated on järgnevad:

- faili nimi ei vasta nõutud formaadile,
- saatja BIC kood ei vasta Eestis tegevusloa saanud investeerimisühingule,
- faili ei suudetud dekrüpteerida (vale võtmega krüpteeritud),
- ebakorrektne faili allkiri,
- XML-skeemi nimi puudub päises,
- XML-skeemi nimi on vale,
- faili sisu ei vasta XML-skeemile,
- ISIN kood on vale,
- kauplemiskoha kood ei ole korrektne MIC kood,
- tühistatav tehing ei eksisteeri (vale panga viitenumber),
- tehingu kuupäev on tulevikus,
- tühistatav tehing on juba eelnevalt tühistatud,
- turul kaubeldava tuletisinstrumendi kauplemiskoha kood ei vasta korrektsele MIC koodile,
- tuletisinstrumendi *put/call* välja sisu on vale,
- tuletisinstrumendi täitmishinna välja sisu on vale,
- vastaspoole BIC kood on vale,



- kliendi kood on vale,
- tehingu hinna välja sisu on vale,
- OTC tuletisinstrumenti alusvara ISIN kood on vale,
- hinnakordaja välja sisu on vale,
- tuletisinstrumenti väärtuspäev on vale,
- tehingu kauplemiskoht ei vasta tehingu liigile,
- valuuta kood on vale.

Edastatava faili allkirjastamine ja krüpteerimine

Käesoleval hetkel toimub failide krüpteerimine vastavalt OpenPGP standardile ning failid saavad laiendi *.gpg. Alternatiivse võimalusena on turuosaliste vastava soovi olemasolul võimalik krüpteerimise vahendina juurutada ka eraisiku ja ettevõtte ID kaardi kasutamist. Sellisel juhul hakkaksid failid kandma *.cdoc laiendit. Tagasiside fail krüpteeritakse samas formaadis, milles oli investeerimisühingu poolt edastatud aruandefail.

Edastatava faili nimekonventsioon

Investeerimisühing saadab TRS-ile faili, mille nimi vastab järgmisele loogikale:

<saatja BIC kood>_DATTXN_EE_<loendur>_<aasta>.gpg või *.cdoc.

Vastuseks genereerib TRS tagasisidefaili, mis sisaldab informatsiooni viimati edastatud aruandes sisaldunud vigades osas ning kannab järgmisele loogikale vastavat nime:

EE_FDBTXN_<saatja BIC kood>_<loendur>_<aasta>.gpg või *.cdoc.

Aruandefaili adressaat

Uue TRS versiooni käivitamise hetkest muutub e-posti aadress, mis võtab vastu aruandefaili ning selleks saab olema trs@fi.ee.

Aruandefailis sisaldunud vigade parandamine

Käesoleval hetkel tuleb eelnevalt edastatud aruandefailis sisaldunud vigade parandamiseks esitada kõik samas failis sisaldunud tehinguandmed uuesti. Planeeritud muudatused võimaldavad edaspidiselt esitada vigade parandusi ka üksikute tehingute kohta, s.t paketipõhiselt andmevahetuselt minnakse üle tehingupõhisele loogikale. Süsteemi muudetud loogika kohaselt loetakse iga sama viitenumbri taaskordselt esitatud teavitus paranduseks.



Aruandefaili andmeväljade muudatused

Uuendatud teavituskorraga lisatakse turuväliste (OTC) tuletisinstrumentidega tehtud tehingutest teavitamise võimalus. Sellistest tehingutest teavitamine on kuni võimaliku vastava seadusemuudatuseni vabatahtlik.

Reguleeritud turgudel kaubeldavate ning ka turuväliste, kuid reguleeritud turgudel kaubeldavat väärtpaberit alusvarana omavate tuletisinstrumentidega tehtud tehingutest teavitamise võimaldamiseks vaadatakse üle andmeväljade struktuur ja koosseis. Muutub teatud väljade nimetus, väljades lubatud andmeformaad ning järjestus eelkõige tuletisinstrumentidega seonduvas osas.

XML generaatori uuendamine

Väiksema tehingutemahuga turuosaliste tarbeks loodud XML generaator uuendatakse vastavalt muutunud andmeväljade struktuurile ja koosseisule. MS Excel'i baasil loodud XML generaator on kättesaadav ja kasutatav kõigile soovijaile.

AJAKAVA JA KONTAKTID

Finantsinspeksioon pakub omalt poolt välja järgneva esialgse ajakava:

- 21.03.2011 – konsultatsiooni algus ja avalikustamine;
- 04.04.2011 – konsultatsiooni algus Rahandusministeeriumiga;
- 21.04.2011 – esmase kirjaliku konsultatsiooni lõpp;
- 18. nädal – vajaduse korral kohtumised või ümarlaud;
- 04.07.2011 – testkeskkonnale ligipääsu võimaldamine ja testperioodi algus;
- 05.09.2011 – rahandusministri määruse muudatuste jõustumine ja uuendatud tehniliste tingimuste dokumendi rakendumine;
- 05.09.2011 – TRS uue süsteemi Go-Live.

Hiljemalt **21.04.2011** on oodatud kõik ettepanekud ning kommentaarid seoses käesolevas dokumendis esitatud informatsiooniga. Konsultatsiooni puudutavate ja ka antud valdkonnaga seotud üldisemate küsimuste korral pöörduda Finantsinspeksiooni riskijuhi Marek Pajussaare poole e-posti aadressile Marek.Pajussaar@fi.ee või telefonil 668 0551 ja palume kõik e-kirjad saata koopiana ka aadressile Roger.Viitmann@fi.ee.