

12.5.2009

RAPORTIN TÄYTTÖOHJEITA

Raportoitava tieto	Täyttöohje
Technical reporting firm identification	<p>Yhtiö, joka raportin toimittaa. Joko arvopaperinvälittäjä itse tai tämän puolesta toimiva muu taho.</p> <p>Raportin toimittavan yhtiön BIC-koodi – ISO 9362. Jos yhtiön BIC-koodi on kahdeksanmerkkinen, täytetään kolme viimeistä merkkiä kirjaimella X, koska järjestelmä edellyttää BIC-koodin olevan 11 merkkinen.</p> <p>BIC-koodin saa SWIFTiltä täyttämällä SWIFTin nettisivuilla olevan lomakkeen. Koodi on maksuton.</p>
Reporting firm identification	<p>Arvopaperinvälittäjä, joka raportoitavat liiketoimet on toteuttanut.</p> <p>Yhtiön BIC-koodi – ISO 9362. Jos yhtiön BIC-koodi on kahdeksanmerkkinen, täytetään kolme viimeistä merkkiä kirjaimella X, koska järjestelmä edellyttää BIC-koodin olevan 11 merkkinen.</p> <p>Pääsääntöisesti käytetään yhtiön pääkonttorin BIC-koodia. Ulkomaisista sivuliikkeistä ja -konttoreista käytetään kuitenkin näiden omaa BIC-koodia, joka yleensä erottuu pääyhtiön koodista kolmen viimeisen merkin avulla.</p> <p>BIC-koodin saa SWIFTiltä täyttämällä SWIFTin nettisivuilla olevan lomakkeen. Koodi on maksuton.</p>
Transaction record info type	<p>Kertoo, että kyseessä on kauppatahtuman raportointi eli raportti toteutetusta liiketoimesta (kaupasta).</p>
Transaction reference number	<p>Raportoijan itse antama yksilöivä numero raportoitavalle liiketoimelle.</p> <p>Raportoitujen liiketoimien tunnistamistieto, jota käytetään Ratan ja raportoijan välisessä kommunikaatiossa, esim. Ratan ilmoittaessa virheellisestä kauppatahtumasta, raportoijan peruessa jo raportoidun kauppatahtuman tai Ratan pyytäessä lisätietoja tietystä kauppatahtumasta.</p> <p>Numeron tulee olla raportojakohtaisesti yksilöivä, esim. pvm + juokseva numero, maksimissaan 40 merkkiä.</p>
Trading date time	<p>Kaupankäyntiaika.</p> <p>Aika, jolloin liiketoimi on todellisuudessa toteutettu, eikä esimerkiksi raportointijärjestelmän generoima keinotekoinen aikaleima.</p> <p>Komission asetuksen mukaan kellonaika ilmoitetaan paikallisena aikana + aikavyöhykkeenä (Suomessa kesällä +03, talvella +02).</p> <p>Kellonajan voi ilmoittaa myös esimerkiksi Ruotsin aikana, kunhan aikavyöhyketieto annetaan vastaavasti.</p> <p>Kellonaika annetaan sillä parhaalla tarkkuudella, millä se on saatavilla. Esimerkiksi puhelimesta sovitun kaupan kellonaika voidaan antaa minuuttien</p>

12.5.2009

Raportoitava tieto	Täyttöohje
	tarkkuudella (raportilla sekunnit silloin 00). Kellonaika on kuitenkin aina annettava.
Buy/Sell indicator	B=buy (osto) tai S=sell (myynti).
	Jos liiketoimi on toteutettu arvopaperinvälittäjän lukuun – arvopaperinvälittäjän kannalta.
	Jos liiketoimi on toteutettu asiakkaan lukuun – asiakkaan kannalta.
Trading capacity	Kenen lukuun liiketoimi on toteutettu.
	P= Principal (arvopaperinvälittäjän omaan lukuun) tai A = Agent (asiakkaan lukuun).
Instrument identification tai Alternative Instrument Identification	Liiketoimen kohteena olevan tuotteen tuotekoodi.
	Tuotekoodina käytetään kaikille käteistuotteille tuotteen ISO 6166 -standardin mukaista ISIN-koodia. ISIN-koodi koostuu maakoodista (2 kirjainta) ja numeroista (10 merkkiä)
	Johdannaissopimuksille käytetään markkinapaikasta riippuen ISIN-koodia tai AII-koodia.
	Johdannaissopimuksia, joiden allaoleva ei ole suoraan tai välillisesti arvopaperi, ei raportoida ollenkaan. Tällaisia ovat mm. hyödyke-, valuutta ja korkojohdannaiset. Valvojat ja markkinapaikat ovat sopineet näiden osalta muusta menettelystä, jolloin raportointia suoraan kaupankäyntiosapuolilta ei tarvita.
	CESRin MIFID-tietokannasta osoitteessa http://mifiddatabase.cesr.eu/ löytyy tieto siitä, kumpaa koodia minkin markkinapaikan tuotteille käytetään (ISIN vai AII).
	AII-markkinapaikat tarjoavat ylläpitämänsä AII-koodit vapaasti kaikkien osapuolten käyttöön. AII-koodi koostuu seuraavasta kuudesta pakollisesta tiedosta:
	AII-koodi koostuu seuraavista kuudesta eri tiedosta:
	Exchange code
	Markkinapaikan MIC-koodi
	Exchange product code
	Markkinapaikan tuotteelle antama yksilöllinen koodi.
	Derivative type
	O = Optio

12.5.2009

Raportoitava tieto	Täyttöohje F = Futuuri
	Put/Call identifier P = Put C = Call F = Futuuri
	Expiry/Delivery/Prompt date Tuotteen toteutus- tai eräpäivä
	Strike price Option lunastushinta. Futuureille merkitään 0.
Unit Price	Yhden arvopaperin tai johdannaissopimuksen hinta ilman välityspalkkiota tai kertyneitä korkoja (ns. puhdas hinta).
	Velkainstrumenteilla hinta %:na (PricePercentage), muilla yksikköhinta valuuttana (PriceCurrency).
Price notation	Valuutta - ISO 4217, jonka määräisenä hinta (Unit Price) on raportoitu.
	Velkainstrumenteilla nimellisarvon valuutta.
Quantity	Liiketoimen kohteena olevien arvopapereiden tai johdannaissopimusten lukumäärä.
	Velkainstrumenteilla liiketoimen kohteena oleva nimellisarvo.
Counterparty code & Counterparty code type	Kauppan vastapuoli on liiketoimessa se, jolta ostetaan tai jolle myydään. Markkinapaikasta riippuen vastapuoli on joko markkinapaikka itse tai toinen markkinapaikalla toimiva arvopaperinvälittäjä. Esimerkiksi Helsingin pörssissä tapahtuvassa kaupankäynnissä arvopaperinvälittäjän vastapuoli on aina toinen arvopaperinvälittäjä. Myös arvopaperinvälittäjän asiakas voi olla kaupassa arvopaperinvälittäjän vastapuolena, jos arvopaperinvälittäjä ostaa tai myy omasta salkustaan suoraan esim. jvk-lainaa asiakkaalleen. Jos vastapuoli on toinen ETA-alueella toimiluvanvarainen arvopaperinvälittäjä Counterparty code type = B ja Counterparty code = ko. vastapuolen BIC-koodi (11 merkkiä tai 8 merkkiä+XXX) Jos vastapuoli on säännelty markkina, MTF tai CCP Counterparty code type = M ja Counterparty code = ko. markkinapaikan MIC-koodi Jos vastapuoli on joku muu (asiakas)

12.5.2009

Raportoitava tieto	Täyttöohje
	Counterparty code type = C ja Counterparty code = arvopaperivälittäjän asiakkaasta käyttämä sisäinen tunnus.
	BIC-koodia voidaan käyttää myös muusta kuin ETA-alueella toimiluvanvaraisesta arvopaperinvälittäjästä, mutta nämä voidaan ilmoittaa myös käyttämällä arvopaperivälittäjän näistä käyttämää sisäistä tunnusta (type=C).
Venue identification	Markkinapaikka, jossa liiketoimi on toteutettu.
	Jos markkinapaikka on säännelty markkina tai MTF VenueCodeType= M Venue = MIC-koodi
	Markkinapaikkojen MIC-koodit ovat saatavilla CESRin MiFID-tietokannasta osoitteessa http://mifidatabase.cesr.eu/ .
	Jos markkinapaikka on sisäisenä toteuttaja toimiva arvopaperinvälittäjä (SI, Systematic Internalizer)
	VenueCodeType= B Venue = BIC-koodi (11 merkkiä tai 8 merkkiä+XXX)
	Jos kauppa on toteutettu markkinapaikkojen ulkopuolella VenueCodeType= O Venue = XOFF
Venue reference transaction number	Markkinapaikan käyttämä kaupanumero on pakollinen tieto, jos liiketoimi on toteutettu NASDAQ OMX Helsingissä tai suomalaisella MTF:llä.
	Voidaan valinnaisesti raportoida myös muiden markkinapaikkojen osalta.
	NASDAQ OMX-käteistuotteille Saxess-järjestelmän kenttä 'trade number from Trade Unicast'.
Client code	Asiakas, jonka lukuun arvopaperinvälittäjä toteuttaa liiketoimen. Client code raportoidaan vain, jos liiketoimi on toteutettu asiakkaan lukuun eli Trading Capacity = A.
	Jos asiakas on ETA-alueella toimiluvanvarainen arvopaperinvälittäjä ClientCodeType= B Client = arvopaperinvälittäjän asiakkaan BIC-koodi
	Muutoin ClientCodeType= I Client = arvopaperinvälittäjän asiakkaasta käyttämä yksilöllinen sisäinen tunnus
Cancellation transaction info type	Kertoo, että kyseessä on aiemmin raportoidun kauppatahtuman peruutus-tapahtuma.
Cancelled transaction	Peruutettavan, aiemmin raportoidun, kauppatahtuman Transaction referen-

12.5.2009

Raportoitava tieto	Täyttöohje
uniquer identifier	ce number.
Cancellation indicator	C (vain kappatapahtuman peruutukselle)
Client name	Asiakkan nimi
Client identifier local	Suomalaisista asiakkaista hetu tai y-tunnus, muista jokin muu yksilöintitunnus esim. syntymäaika
Client street	Katuosoite
Client zip code	Postinumero
Client city	Kaupunki tai kunta
Client country	Kotimaa
Proxy holder – beneficial owner	Toimeksiannon antaja - valtakirjan haltija