esma European Securities and Markets Authority

Suunised

MiFID II tehinguaruandlus, korralduste arvestuse pidamine ja kellade sünkroonimine

02/10/2017 | ESMA/2016/1452 ET

Sisukord

Sisukord ... 3

Kommenteeritud kokkuvõte ... 9

1 Kohaldamisala ... 10

2 Mõisted ... 10

3 Eesmärk ... 10

4 Vastavus- ja aruandluskohustused ... 11

5 Tehinguaruandluse suunised ... 11

I osa. Üldpõhimõtted ... 13

5.1 Aruandluse üldkirjeldus ... 13

5.2 Kauplemisvolitused ... 15

5.2.1 Kauplemine oma arvel (DEAL) ... 15

5.2.2 Kliendikorralduste sobitamistehingud (MTCH) ... 18

5.2.3 Kauplemine „muu volituse alusel“ (AOTC) ... 19

5.2.4 Kauplemisvolituste piirangud ... 21

5.3 Aruandlusahelad ja edastamine ... 21

5.3.1 Üldist ... 21

5.3.2 Ahel, milles ühing kaupleb oma arvel või kliendikorralduste sobitamistehingutega ... 22

5.3.3 Edastamine ... 22

5.4 Tehingu sooritamine kauplemiskohas ... 23

5.4.1 Kauplemiskoha tehingu tunnuskood (väli 3) ... 23

5.4.2 Koha välja täitmine ahelate korral (väli 36) ... 24

5.5 Poolte tunnuskoodid ... 24

5.5.1 CONCAT-koodi genereerimise kord ... 24

5.5.2 Eesnimi (-nimed) ja perekonnanimi (-nimed) ... 27

5.6 Tehingu mõiste ... 27

5.6.1 Omandamised ja võõrandamised ... 27

5.6.2 Aruandluskohustuse erandid ... 27

5.7 Aruandlusmehhanismid ... 32

5.7.1 Mittekohaldatavad väljad ja instrumentide võrdlusandmete väljade täitmine ... 32

5.7.2 Tehinguaruannete esitamine ... 33

II osa. Plokid ... 33

5.8 1. plokk: ostja/müüja andmed ... 33

5.8.1 Ostja/müüja, kellele võidakse määrata LEI ... 34

5.8.2 Ostja/müüja on füüsiline isik ... 34

5.9 2. plokk: ostja/müüja otsustaja 38
5.9.1 Otsustajaks on ostja/müüja 38
5.9.2 Otsustajaks on ostja/müüja volitatud kolmas isik 39
5.10 3. plokk (1. ja 2. ploki kombinatsioon): Ostja/müüja ja otsustaja eristsenaariumid 41
5.10.1 Ostja/müüja on ühiskonto 41
5.10.2 Müüja on surnud 42
5.11 4. plokk: ühingusisese investeerimisotsuse väli 43
5.11.1 Ühingusisese investeerimisotsuse väli 43
5.11.2 Väljaspool ühingut tehtud investeerimisotsus (investeerimisotsuse teeb klient ning investeerimisühing tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel või „muu volituse alusel“) 44
5.12 5. plokk: ühingusisese täitmise väli 44
5.12.1 Täitmise eest vastutas peamiselt füüsiline isik 45
5.12.2 Täitmise eest vastutas peamiselt algoritm 45
5.13 6. plokk: kauplemise kuupäev ja aeg 45
5.14 7. plokk: koht 46
5.14.1 Tehingu sooritamine kauplemiskohas anonüümses tellimusraamatus 46
5.14.2 Tehingu sooritamine Euroopa Liidu välisel kauplemisplatvormil mitteanonüümses tellimusraamatus 47
5.14.3 Tehingu sooritamine kauplemiskohas oma korralduse täitmisega anonüümses tellimusraamatus 48
5.14.4 Tehingu sooritab kliendi korralduste süsteemne täitja 49
5.15 8. plokk: lühikeseks müügi indikaator 51
5.15.1 Investeerimisühingu X klient müüb lühikeseks (ühingul X on vastav teave) 51
5.15.2 Investeerimisühing X müüb lühikeseks enda nimel 52
5.16 9. plokk: vabastuse, börsivälise kauplemise järgse etapi ja kaubatuletisinstrumendi indikaatorid 53
5.16.1 Vabastuse indikaator ja börsivälise kauplemise järgse etapi indikaator 53
5.16.2 Kauplemisjärgne indikaator juhul, kui investeerimisühing viib börsiväliselt kokku kaks kliendikorraldust 57
5.16.3 Kaubatuletisinstrumendi indikaator 57
5.17 10. plokk: filiaalid 58
5.17.1 Kliendi nimel sooritatud tehing 58
5.17.2 Oma arvel sooritatud tehing 60
5.17.3 EMP-väliste ühingute EMP filiaalide sooritatud tehingud 62
5.18 11. plokk: tehinguaruannete olek ja parandused 63
5.18.1 Tühistamised ja muudatused samal päeval 64
5.18.2 Uue tehinguaruande esitamine 64
5.18.3 Tühistamine 64

5.18.4 Tehinguaruandes sisalduva teabe parandamine 65
5.19 12. plokk: tingliku väärtuse muutus 67
5.19.1 Tingliku väärtuse suurenemine 67
5.19.2 Tingliku väärtuse vähenemine 70
5.19.3 Täielik ennetähtaegne lõpetamine 72
III osa. Kauplemisstsenaariumid 72
5.20 Väärtpaberite ülekandmine 72
5.20.1 Ülekandmine sama ühingu klientide vahel 72
5.20.2 Kahe eri investeerimisühingu klientide vaheline ülekanne 73
5.20.3 Ühingud, kes viivad börsiväliselt kokku kaks kliendikorraldust 75
5.21 Investeerimisühingute poolt edasisuunamine omapoolse vahenduseta 77
5.21.1 Investeerimisühing viib kokku kaks kliendikorraldust omapoolse vahenduseta 77
5.21.2 Investeerimisühing suunab kliendi teise investeerimisühingusse omapoolse vahenduseta 78
5.22 Ühe kliendi ühe korralduse täitmine mitme tehinguga 79
5.22.1 Kliendi korralduse täitmine kauplemiskohas tehingu sooritamise ja seejärel kliendi teenindamisega investeerimisühingu oma portfellist 79
5.22.2 Kliendi korralduse täitmine instrumentide osalise omandamisega kauplemiskohast ja kliendi teenindamisega investeerimisühingu oma portfellist 82
5.23 Korralduste grupeerimine 84
5.23.1 Üks turutehing mitme kliendi nimel 85
5.23.2 Mitu turutehingut mitme kliendi nimel 88
5.24 Organiseeritud kauplemissüsteem tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel 102
5.25 Väärtuspõhised tehingud tasakaalustusühikuga 107
5.26 Aruandlusahelad ja edastamine 109
5.26.1 Ahelad, kus artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused ei ole täidetud 110
5.26.2 Ahelad, kus artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused on täidetud, kuid mitte kõik teised artikli 4 tingimused 113
5.26.3 Ahelad, milles kõik investeerimisühingud vastavad komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 tingimustele 122
5.26.4 Ahelad, kus komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud tingimused on mõne ahelas osaleva investeerimisühingu korral täidetud 130
5.27 Investeerimisühing tegutseb mitme kliendi kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel ... 143
5.27.1 Investeerimisühing tegutseb mitme kliendi kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel, kuid ei vasta edastamise tingimustele (koondkorralduste ja ahelate/edastamise kombinatsioon) 143
5.27.2 Investeerimisjuht tegutseb mitme kliendi kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel ja vastab edastamise tingimustele 155
5.28 Otsene elektrooniline juurdepääs 163

5.28.1 1. stsenaarium: otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient kaupleb oma arvel ja tal puudub aluseks olev klient 163

5.28.2 2. stsenaarium: otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient tegutseb kliendi nimel 165

5.29 Riskimaandamine hinnavahelepingutega 169

5.30 Kauplemiskoha aruanne tema süsteemide kaudu sooritatud tehingu kohta vastavalt MiFIRi artikli 26 lõikele 5 171

5.30.1 Ühing kaupleb oma arvel. 171

5.30.2 Ühing kaupleb „kliendikorralduste sobitamise teel“ või „muu volituse alusel“ üksnes ühe kliendi nimel 173

5.30.3 Ühing koondab mitme kliendi korraldusi 174

5.31 Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingud 176

IV osa. Eri liiki instrumentide aruandlus 177

5.32 Põhimõtted 177

5.33 Kauplemiskohas kaubeldavate või ESMA nimekirjas sisalduvate finantsinstrumentide identifitseerimine 177

5.34 Kauplemiskohas mittekaubeldavate või ESMA nimekirjas puuduvate finantsinstrumentide identifitseerimine 178

5.34.1 Finantsinstrumendid, millega kaubeldakse Euroopa Liidu välisel organiseeritud kauplemisplatvormil (EMP-välises kauplemiskohas) 178

5.34.2 Börsivälised tuletisinstrumendid 179

5.35 Konkreetsete finantsinstrumentide aruandlus 180

5.35.1 Aktsiad ja aktsialaadsed instrumendid 180

5.35.2 Võlakirjad või muus vormis väärtpaberistatud võlad 181

5.35.4 Hinnavaheleping 190

5.35.5 Kihlvedu 191

5.35.6 Krediidiriski vahetustehing 197

5.35.7 Vahetuslepingud 199

5.35.8 Kauba tuletisinstrumendid 215

5.35.9 Komplekstehingud 220

6 Korralduste arvestuse pidamise suunised 223

I osa. Üldpõhimõtted 223

6.1 Korralduste arvestuse pidamise nõuete kohaldamisala 223

6.2 Kauplemiskoha liikmed või osalised 223

6.3 Kliendi tunnuskood (väli 3) 224

6.3.1 Väljale 3 (kliendi tunnuskood) täitmine koondkorralduste korral 224

6.3.2 Välja 3 (kliendi tunnuskood) täitmine, kui jaotamist ei ole veel toimunud 225

6.4 Mittesooritav maakler (väli 6) 225

6.5 Korralduse seisund (väli 33) 225
6.6 Kehtivuse kuupäev ja aeg (väli 12) 225
6.7 Passiivsus- või agressiivsusnäitaja (väli 44) 226
6.8 Kauplemiskoha tehingu tunnuskood (väli 48) 226
6.9 Järjenumber (väli 15) 226
6.10 Kehtivusaeg (väli 10) 230
6.10.1 Päeva jooksul kehtivuse (DAVY) indikaator 230
6.10.2 Kehtivusaja kahe indikaatori kombinatsioon: pärast kuupäeva kehtiv korraldus (GADV) ja kuni kuupäevani kehtiv korraldus (GTDV) 230
6.11 Likviidsuse pakkumine (väli 8) 231
II osa. Stsenaariumid 232
6.12 Selgitus 232
6.13 Keskne limiidiga korralduste tellimusraamat 233
6.13.1 Uued korraldused ja tühistamine/muutmine (väli 21) 233
6.13.2 Täiendav määratud hind (väli 25) 237
6.13.3 Varjatud limiidiga korralduse liigitamine 238
6.13.4 PEG-korraldused 240
6.13.5 Stopp-korralduse liigitamine 244
6.13.6 suunatud korraldused; 246
6.13.7 Strateegiapõhiste korralduste liigitamine (väli 46) 253
6.13.8 Prioriteetsuse muutmine 266
6.13.9 Kauplemisetapid 270
6.14 Noteeringutaotluse süsteemid 280
6.14.1 Kuidas registreerida noteeringutaotlus, mis on saadetud konkreetsetele vastaspooltele? 281
6.14.2 Kuidas registreerida piiratud kehtivusajaga („rippumisaeg“) noteering, mille alusel saab tehingu teha konkreetne noteeringu taotleja 282
6.14.3 Kuidas registreerida noteering, mille kogus erineb taotletust 283
6.14.4 Kuidas registreerida noteeringutaotluse süsteemis täitmine 284
7 Kellade sünkroonimise suunised 286
7.1 Teatamisele kuuluvad sündmused 286
7.2 Ajatemplite detailsus 286
7.3 Maksimaalset kõrvalekaldumist käsitlevate nõuete täitmine 289
7.3.1 Liigsekundid 290
7.3.2 Kohalik kellaaeg ja erinevus maailmaajast 290
7.3.3 Kohaldamine investeerimisühingutele, kes ei ole kauplemiskoha vahetud liikmed või osalised 290

7.4 Rakenduste, hostide ja liinide ajatemplid 290
7.5 Lüüsidevaheline latentsusaeg 291
8 Lisad 291
I lisa. Esitajatelt saadud aruannete töötlemine 291

Kommenteeritud kokkuvõte

Suuniste avaldamise põhjused

Pärast tehinguaruandluse, korralduste arvestuse pidamise ja kellade sünkroonimise regulatiivsete tehniliste standardite (komisjoni delegeeritud määrused (EL) 2017/590, (EL) 2017/580 ja (EL) 2017/574[1]) projektide valmimist asus ESMA enda algatusel käsitlema meetmeid, millega tagada järelevalvelist ühtsust nende standardite rakendamisel.

Käesolevad suunised kajastavad selle tegevuse tulemusi ja järgivad 2015. aasta detsembris avaldatud konsulteerimisdokumenti.[2]

Sisukord

1., 2. ja 3. jaotises kirjeldatakse suuniste kohaldamisala, mõisteid ja eesmärki. 4. jaotises kirjeldatakse suuniste täitmise korda. 5. ja 6. jaotises on stsenaariumid, mida saab kohaldada konkreetsete tehingute ja korralduste arvestuse pidamise toimingute suhtes. Igale stsenaariumile on lisatud täpne tehniline programmeerimisjuhend, mida kasutada konkreetsete aruandeväärtuste esitamiseks. Lisaks aruandlus- ja arvestuse pidamise stsenaariumidele sisaldavad need jaotised palju muid komisjoni delegeeritud määruste (EL) 2017/590 ja (EL) 2017/574 nõuete kohaldamise selgitusi, mida turuosalised soovisid standardite arutelul, ent mida nende soovide üksikasjalikkuse ja spetsiifilisuse tõttu ei saanud käsitleda lõplikes tehnilistes standardites. 7. jaotises selgitatakse kellade sünkroonimise nõuete kohaldamist (komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/574).

[1] 28. septembril 2015 Euroopa Komisjonile esitatud ESMA tehniliste standardite kavandid (ESMA/2015/1464) on avaldatud ESMA veebilehel järgmisel aadressil: https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015/11/2015-esma-1464_annex_i_-_draft_rts_and_its_on_mifid_ii_and_mifir.pdf

[2] Tehinguaruandluse, korralduste arvestuse pidamise ja kellade sünkroonimise suuniste konsulteerimisdokument (ESMA/2015/1909) on avaldatud ESMA veebilehel järgmisel aadressil: https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2015-1909_guidelines_on_transaction_reporting_reference_data_order_record_keeping_and_clock_synchronisation.pdf

1 Kohaldamisala

Sihtrühm
Suuniseid kohaldatakse investeerimisühingutele, kauplemiskohtadele, tunnustatud aruandlussüsteemide pakkujatele ja pädevatele asutustele.

Käsitlusala
Suuniseid kohaldatakse tehinguaruannete esitamisel vastavalt Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 600/2014 (MiFIR)[3] artiklile 26; korralduste arvestuse pidamisel vastavalt MiFIRi artiklile 25 ning äritegevuses kasutatavate kellade sünkroonimisel vastavalt Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL (MiFID II)[4] artiklile 50.

Jõustumine
Suuniseid kohaldatakse alates 3. jaanuarist 2018.

2 Mõisted

Suunistes kasutatakse mõisteid samas tähenduses kui Euroopa Parlamendi ja nõukogu MiFID II-s ja MiFIRis. Lisaks kasutatakse suunistes mõistet „ühingud“, mis tähendab kõiki ühinguid, mis ei ole investeerimisühingud MiFID II tähenduses, kui ei ole märgitud teisiti.

Tehinguaruandluse suunistes tähendavad konkreetsed andmeväljad komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590[5] I lisa tabeli 2 välju ja korralduste arvestuse pidamise suunistes komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580[6] lisa tabeli 2 välju.

3 Eesmärk

Suuniste eesmärk on anda investeerimisühingutele, [7] kauplemiskohtadele, [8] tunnustatud aruandlussüsteemide pakkujatele[9] ja kliendi korralduste süsteemsetele täitjatele[10] juhised MiFIRi ning komisjoni delegeeritud määruste (EL) 2017/590, (EL) 2017/580 ja (EL) 2017/574[11] järgsete aruandlus- ja korralduste arvestuse pidamise sätete täitmiseks. Suuniste ülesanne on tagada nimetatud nõuete

---

3 Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta määrus (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012 (ELT L 173, 12.6.2014, lk 84).
4 Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiiv 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL (ELT L 173, 12.6.2014, lk 349).
5 KOMISJONI 28. juuli 2016. aasta DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/590, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad pädevatele asutustele tehingutest teatamist. http://eur-lex.europa.eu/legal-content/ET/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0449.01.EST&toc=OJ:L:2017:087:TOC
6 KOMISJONI 24. juuni 2016. aasta DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/580, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad finantsinstrumentidega seotud korralduste asjaomaste andmete säilitamist. http://eur-lex.europa.eu/legal-content/ET/TXT/?uri=uriserv:OJ.L_.2017.087.01.0193.01.EST&toc=OJ:L:2017:087:TOC
[7] Nagu on määratletud MiFID II artikli 4 lõike 1 punktis 1.
[8] Nagu on määratletud MiFID II artikli 4 lõike 1 punktis 24.
[9] Nagu on määratletud MiFID II artikli 4 lõike 1 punktis 54.
[10] Nagu on määratletud MiFID II artikli 4 lõike 1 punktis 20.
[11] KOMISJONI 7. juuni 2016. aasta DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/574, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL seoses äritegevuses kasutatavate kellade täpsust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega.

järjepidev kohaldamine. Suunised keskenduvad eelkõige tehinguaruannete ja korralduste andmete kirjete väljade kaupa koostamisele mitmesuguste võimalike stsenaariumide korral. Et võimalikke stsenaariume on väga palju, ei ole suunistes ammendavat stsenaariumide loetelu. Seega peaksid suuniste adressaadid kasutama kirjete ja aruannete koostamiseks kõige sarnasema stsenaariumi elemente. Kõik suuniste põhimõtted kehtivad üksnes MiFIRi artikli 25 (tehinguandmete arvestuse pidamise kohustus), MiFIRi artikli 26 (tehinguaruandluse kohustused) ja MiFID II artikli 50 suhtes (äritegevuses kasutatavate kellade sünkroonimine).

Kõik suunistes kasutatavad ees- ja perekonnanimed on väljamõeldud.

4 Vastavus- ja aruandluskohustused

Suuniste staatus

Dokument sisaldab suuniseid, mis on välja antud ESMA määruse artikli 16 kohaselt. Kooskõlas ESMA määruse artikli 16 lõikega 3 peavad pädevad asutused ja finantsturu osalised tegema kõik, et suuniseid ja soovitusi järgida.

Pädevad asutused, kelle suhtes suuniseid kohaldatakse, peaksid suuniseid järgima, võttes need üle oma järelevalvetavadesse, ka siis, kui teatud suunised on suunatud peamiselt finantsturu osalistele.

Aruandluskohustus

Pädevad asutused, kelle suhtes käesolevaid suuniseid kohaldatakse, peavad kahe kuu jooksul pärast käesoleva dokumendi avaldamist ESMA poolt ESMA-le teatama, kas nad järgivad neid suuniseid või kavatsevad hakata neid järgima, koos mittejärgimise põhjustega, e-posti aadressile MiFIRreportingGL@esma.europa.eu. Kui selleks tähtajaks teadet ei saada, peab EBA pädevat asutust nõudeid mitte täitvaks. Teate vorm on ESMA veebilehel.

Finantsturu osalised ei pea teatama, kas nad järgivad käesolevaid suuniseid või mitte.

5 Tehinguaruandluse suunised

See tehinguaruandluse jaotis koosneb neljast osast.

- **I osa – üldpõhimõtted.** Tehinguaruandluse üldpõhimõtete kirjeldus. Käsitletakse tehinguaruande koostamise viisi ning seda, mis tingimustel ja kuhu tuleb aruanne saata. Osas on üldised aruandluse lähenemisviisid ja täiendavad suunised komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõikes 5 sätestatud tehingu määratluse teatud erandite kohta.

- **II osa – plokid.** Käsitleb plokke (väljakogumeid), milles igaühes on teatud teema väljad koos täitmisnäidetega. Plokkide ülesehitus on üksteisest sõltumatu.

- **III osa – stsenaariumid.** Näiteid mitmesuguste kauplemisstsenaariumide kohta, millega aruande esitaja võib kokku puutuda. Eelkõige käsitletakse korralduste edastamise, grupeeritud korralduste ja otsese elektroonilise juurdepääsu pakkumisega seotud tehinguid.

• **IV osa – instrumendid.** Mitmesuguste finantsinstrumentidega seotud aruandlussuunised.[12] Enamik näiteid keskendub tuletisinstrumentidele, sest seda liiki finantsinstrumentide aruandluse kord on keerukam.

Siin dokumendis on iga näite kohta tabel, milles on asjakohased väljad ja neid andmeid kajastav eeldatav XML-tekst. Kui ei ole märgitud teisiti, tuleb tabelit ja XML-i tõlgendada nii:

a) „Nr“ tähendab välja numbrit ja „Väli“ selle nimetust komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabelis 2.

b) Veerus „Väärtused“ on eeldatavad näite konkreetsed väärtused, mis esitatakse ülakomade vahel. Mõnel juhul on selle asemel kasutatud kirjeldavat väärtust, nt „Ühingu X {LEI}“. Need väärtused tuleks asendada kirjeldusele vastava tegeliku väärtusega. Kus märgitud, kasutatakse selgituses sisalduvaid väljamõeldud isikute väärtusi ka XML-is. Sulgudes terminid tähendavad komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabelis 1 kirjeldatud andmeliike.

c) Tühjad lahtrid väärtuste veerus tähendavad konkreetselt, et näidisstsenaariumi korral neid lahtreid ei kasutata ja need tuleb jätta tühjaks.

XML-teksti väljavõtted illustreerivad andmete vormingut pädevale asutusele esitatavas failis. ISO 20022 metoodika rakendamiseks tuleb siiski tutvuda sõnumite täieliku tehnilise kirjeldusega ning lähtuda sõnumite õigel vormistamisel üksnes täielikust tehnilisest kirjeldusest aadressil https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf

Kõik näidete instrumendid on finantsinstrumendid, mille aruandlus on MiFIRi artikli 26 lõike 2 kohaselt kohustuslik.

Aruandluse kirjeldus on esitatud üksnes näite isikute kohta, kuid see ei välista võimalust, et sama näite korral võib olla aruandluskohustusi ka teistel isikutel.

Kõik kellaajad on koordineeritud maailmaaja (UTC) järgi, kui ei ole märgitud teisiti. Kuupäevad ja kellaajad on esitatud komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/590 nõutava kohustusliku vähima detailsusega (I lisa, tabel 2, väli 28) ning need võib aruandes esitada suurema detailsusega, nagu selgitatakse punktis 7.2.

Aruande kellaaegade detailsuse suhtes eeldatakse, et kogu kauplemine toimub elektrooniliselt, kuid mitte välkkauplemisena.

Kui ei ole märgitud teisiti, tegutsevad näidete aruandeid esitavad investeerimisühingud „muu volituse alusel“.

Selgitus: Ühing X (LEI: 12345678901234567890) on investeerimisühing. Ühing Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) on investeerimisühing. Ühing Z (LEI: 88888888888888888888) on investeerimisühing. Klient A (LEI: AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA) on juriidiline isik. Klient B (LEI: BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB) on juriidiline isik. Klient C (LEI: CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC) on juriidiline isik.

[12] Nagu on määratletud MiFID II artikli 4 lõike 1 punktis 15.

Kauplemiskoht M (segmendi MIC: 'XMIC'). See kauplemiskoht haldab anonüümset tellimusraamatut keskse vastaspoolega,[13] kelle LEI on 11111111111111111111.

Klient 1: füüsiline isik Jean Cocteau, Prantsusmaa kodanik, sünnikuupäev 4. juuni 1962 (tuletatud kood: FR19620604JEAN#COCTE).

Klient 2: füüsiline isik Jose Luis Rodriguez de la Torre, Hispaania kodanik, sünnikuupäev 27. veebruar 1976. Jose Luis Rodriguezi Hispaania maksukohustuslasena registreerimise number on 99156722T.

Esindaja 1: füüsiline isik Fabio Luca, Itaalia kodanik, maksukood ABCDEF1234567890, sünnikuupäev 11. oktoober 1974.

Kaupleja 1: Peter Morgan, Kanada kodanik (passi nr 1112223334445555), tegutseb ühingu X nimel.

Kaupleja 2: Peter Jones, Ühendkuningriigi kodanik, Ühendkuningriigi sotsiaalkindlustusnumber AB123456C, tegutseb ühingu X nimel.

Kaupleja 3: John Cross, Belgia kodanik, riiklik number 12345678901, tegutseb ühingu X nimel.

Kaupleja 4: Marie Claire, Prantsusmaa kodanik, sünnikuupäev 2. detsember 1963 (tuletatud kood: FR19631202MARIECLAIR), tegutseb ühingu Y nimel.

Kaupleja 5: Juliet Stevens, Soome kodanik, isikukood 311280-888Y, tegutseb ühingu Z nimel.

Kaupleja 6: Adam Jones, Ungari kodanik, sünnikuupäev 13. aprill 1980 (tuletatud kood: HU19800413ADAM#JONES), tegutseb ühingu Z nimel.

NB! Ruumi säästmiseks ja näidetega illustreeritavatele põhiteemadele keskendumise huvides loetletakse näidetes, nende tabelites ja XML-is ainult osa väljadest, mida komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/590 tegelikult nõuab. Väljad, mida näites selge sõnaga ei mainita, ei pruugi olla ebaolulised. Aruandlus peab hõlmama kõiki reaalse tehinguga seotud välju.

Õige tehinguaruandluse tagamiseks tuleb seda dokumenti lugeda koos MiFID II, MiFIRi ning komisjoni delegeeritud määruste (EL) 2017/590, (EL) 2017/580 ja (EL) 2017/574 asjakohaste sätetega. ESMA ja pädevad asutused võivad lisaks avaldada tehnilisi kirjeldusi.

I osa. Üldpõhimõtted

5.1 Aruandluse üldkirjeldus

Tehinguaruandluse ülesanne on anda pädevatele asutustele tehingute kohta teavet. Selle eesmärk on kajastada tehingut nii, et pädev asutus saaks ülevaate tehingu sooritamise kõigist asjakohastest

asjaoludest. Olenevalt investeerimisühingu tehingute mahust ja sellest, kas ta tegutseb kliendi nimel või mitte, võidakse nõuda ka sama tehingu kajastamist mitmes aruandes.

Et pädevad asutused saaksid täita oma komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 põhjenduses 32 märgitud ülesandeid, vajavad nad täpset ja igakülgset teavet MiFIRi artikli 26 aruandluskohustuste reguleerimisalasse kuuluvate tehingute kohta. Seega, nagu on mainitud põhjenduses 11 ja üksikasjalikumalt kirjeldatud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 15 lõikes 5, peab investeerimisühing tagama, et investeerimisühingu kui tehingute sooritaja esitatavad tehinguaruanded kokku kajastaksid asjaomaste finantsinstrumentidega tehingute tegemise aja seisuga täpselt kõiki tema ja tema klientide positsioonide muudatusi, mis tulenevad aruandluskohustuse alla kuuluvatest tehingutest.[14] Kui näiteks investeerimisühing omandab enda kulul finantsinstrumente ja müüb seejärel sama arvu instrumente oma kliendile, peaksid investeerimisühingu aruanded näitama, et investeerimisühingu netopositsiooni muutus on null ning instrumendid on omandanud klient. See põhimõte kehtib olenemata sellest, kas mõne või kõik aruanded esitab investeerimisühing ise, tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja või kauplemiskoht. Näiteks investeerimisühing, kes laseb tehingu turupoole andmed esitada kauplemiskohal, ei peaks sama turupoole tehingu kohta esitama tehinguaruannet. Kui tehing sooritatakse kliendi nimel, ei peaks investeerimisühing vastavalt käesolevatele suunistele esitama selle tehingu kohta eraldi tehinguaruannet kliendikorralduste sobitajana ega ka „muu volituse alusel“, sest see suurendaks tehislikult tehingute arvu, mille tegijaks see investeerimisühing on aruannetes märgitud. Lisaks peaksid investeerimisühingu eri aruanded olema sama tehingu korral üksteisega kooskõlas ning täpselt kajastama investeerimisühingu, tema vastaspoolte, klientide ja klientide volitatud esindajate rolle.

MiFIRi artikli 26 lõike 1 kohaselt peaksid finantsinstrumentidega tehinguid tegevad investeerimisühingud esitama aruanded nende tehingute täielike ja täpsete üksikasjade kohta. See tähendab, et kaks omavahel kauplevat investeerimisühingut esitavad kumbki oma aruande, mis kajastab tehingut tema seisukohast. Samas peab kummagi investeerimisühingu aruandes olema järgmiste (kahe investeerimisühingu vahel toimunud tehingu ühiseid objektiivseid elemente kirjeldavate) väljade sisu sama: kauplemiskoht,[15] kauplemise kuupäev ja aeg,[16] kogus, koguse valuuta, hind, hinna valuuta, ettemakse, ettemakse valuuta ning instrumendi andmed, kus asjakohane.

Investeerimisühingu tehinguaruanded peaksid lisaks teabele tehingu turupoole kohta sisaldama ka teavet seonduva kliendile ülekandmise kohta, kui see on asjakohane. Näiteks kui kliendi nimel tegutsev investeerimisühing X ostab finantsinstrumente teiselt ühingult või investeerimisühingult Y, peaks X aruandes märkima, et ta kauples Y-ga X-i kliendi nimel.[17] Kui X ostab finantsinstrumente oma arvel ja müüb need finantsinstrumendid kliendile, tuleks ost investeerimisühingult Y ja müük kliendile kajastada kahes eraldi oma arvel sooritatud tehingu aruandes. Samamoodi peaks investeerimisühing siis, kui ta sooritab mitme kliendi nimel koondtehingu teise ühingu või investeerimisühinguga, esitama aruanded koondtehingu (plokktehingu) kohta ühingu või investeerimisühinguga (turupool) ning üksikülekannete kohta klientidele (kliendipool).

Näiteks kui investeerimisühing kaupleb kauplemiskohas kliendi nimel oma arvel, peaks ta esitama kaks tehinguaruannet: üks kauplemiskohaga sooritatud tehingu kohta (turupool) ja teine kliendiga sooritatud

[14] Oluline on märkida, et aruandlusnõuete eesmärk ei ole saada ülevaadet investeerimisühingu või investeerimisühingu kliendi tegelikust positsioonist. Vaja on esitada teave aruandluskohustuse alla kuuluvatest tehingutest tulenevate muutuste kohta positsioonides.
[15] Turupoolte vahel tehingukohas tehtud tehingute kohta (st mitte seonduva kliendile ülekandmise kohta).
[16] Olenevalt investeerimisühingutele kohaldatavatest erinevatest detailsusnõuetest – vt punkt 7.2.
[17] V.a kui see vastab komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamisnõuetele – vt punkt 5.26.

tehingu kohta (kliendipool). Kui investeerimisühing tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel või „muu volituse alusel“ ainult ühe kliendi nimel, peaks ta esitama üksnes ühe tehinguaruande, mis hõlmab nii turu- kui ka kliendipoolt ning peaks sisaldama kõiki selle kliendi suhtes kohaldatavaid välju. Neid põhimõtteid illustreerib järgmine joonis:

|

Client	Klient
Client Side	Kliendipool
Investment Firm X	Investeerimisühing X
Market Side	Turupool
Investment Firm Y	Investeerimisühing Y
Investment Firm Y executed on venue	Investeerimisühing Y sooritas kauplemiskohas
Trading venue	Kauplemiskoht

5.2 Kauplemisvolitused

Nagu on sätestatud komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/590 (väli 29), saab aruandesse märkida kolm eri kauplemisvolitust: kauplemine oma arvel, kliendikorralduste sobitamine ja „muu volituse alusel“. Aruandesse märgitud kauplemisvolitused peaksid kajastama kauplemisvolitust, mille alusel investeerimisühing tegelikult kauples, ning olema kooskõlas tema kauplemisaruandes või -aruannetes esitatud muu teabega.

5.2.1 Kauplemine oma arvel (DEAL)

Kui investeerimisühing kaupleb oma arvel, peaks ta olema tehinguaruandesse märgitud ostja või müüjana. Vastav müüja või ostja on vastaspool või klient või kauplemiskoht, [18] kellega investeerimisühing kaupleb. Investeerimisühing võib tegutseda üksnes oma tehingute sooritamiseks või tegutseda oma arvel kliendilt saadud korralduste täitmiseks. Viimasel juhul võib kauplemise kellaaeg ja kuupäev olla kliendipoole aruandes sama või hilisem kui turupoole aruandes ning hind võib olla turupoole ja kliendipoole aruandes sama või erinev.

5.2.1.1 Tehingud endale

1. näide

Oma arvel enda jaoks tehinguid sooritav investeerimisühing X ostab finantsinstrumente kauplemiskohas M.

[18] Nagu on märgitud 7. plokis.

Investeerimisühingu X aruanne peaks olema järgmine:

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> </Tx> … </New> </Tx>
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	

5.2.1.2 Tehingud kliendile

2. näide

Investeerimisühing X saab kliendilt A korralduse osta finantsinstrument. Investeerimisühing X sooritab tehingu oma arvel, ostes instrumendi kauplemiskohas M ning müües instrumendi kliendile A.

Nagu eespool märgitud, võib hind olla investeerimisühingu X eri aruannetes erinev, nt võib ta osta kohast/vastaspoolelt hinnaga 0,352 GBP ja müüa kliendile A hinnaga 0,370 GBP, mis juhul peaks ta esitama järgmise aruande:

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
4	Sooritaja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’

33	Hind	‘0.352’	‘0.370’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’[19]

XML:

1. aruanne	2. aruanne
<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> … <TradVn>XMIC</TradVn> … </Tx> </New> </Tx>	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.37</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> … <TradVn>XOFF</TradVn> … </Tx> </New> </Tx>

3. näide

Investeerimisühing X saab kliendilt A korralduse osta finantsinstrumente ning täidab korralduse oma portfellist.

[19] Tähise ‘XOFF’ kasutamine koha väljal: vt punkt 5.4.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <TradVn>XOFF</TradVn> … </Tx> … </New> </Tx>
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	
36	Koht	‘XOFF’	

5.2.2 Kliendikorralduste sobitamistehingud (MTCH)

Vastavalt MiFID II artikli 4 lõike 1 punktile 38 on kliendikorralduste sobitamistehing „tehing, kus korraldaja paikneb tehingus ostja ja müüja vahel selliselt, et teda ei ohusta kogu tehingu tegemise aja jooksul tururisk […]“. Seega peaks tehinguaruanne näitama, et tehingu sooritanud investeerimisühingu positsioon tehingu tulemusena ei muutunud.

Kui kliente on ainult üks, tuleks esitada ainult üks tehinguaruanne, mis sisaldab nii turu- kui ka kliendipoole teavet. Klient tuleks märkida ostja/müüja väljale ja koht või vastaspool müüja/ostja väljale. Kui kliente on mitu, võib kasutada klientide koondkontot (korralduste grupeerimine: vt punkt 5.23), et seostada turupool igale kliendile tehtavate ülekannetega nagu 61. näites, ning kliendipoole aruanded peaksid sisaldama kõiki kohaldatavaid välju.

4. näide

Kui punkti 5.2.1 esimeses näites kirjeldatud tehing toimus kauplemiskohas M 9. juunil 2018 kell 09.30.42,124356 hinnaga 0,352 GBP ning investeerimisühing X sooritas kliendikorralduste sobitamistehingu, peaksid investeerimisühingu X aruanded olema järgmised:

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> <TradDt>2018-06-09T09:30:42.124Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> … <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> … </New> </Tx>
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-09T09:30:42.124Z’	
29	Kauplemisvolitused	‘MTCH’	
33	Hind	‘0.352’	
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	

5.2.3 Kauplemine „muu volituse alusel“ (AOTC)

Muu tegevus, mis ei kuulu oma arvel kauplemise ega kliendikorralduste sobitamistehingu määratluse alla, tuleks aruannetes kajastada „muu volituse alusel“ toimunud kauplemisena, mis hõlmab ka tegutsemist agendilepingu alusel.

5. näide

Kliendi A nimel kauplev investeerimisühing X ostab finantsinstrumendid kauplemiskohas M. Tehing toimus 9. juunil 2018 kell 09.30.42,124356 hinnaga 0,352 GBP.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> <TradDt> 2018-06-09T09:30:42.124Z </TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> … <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">0.352</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> … <TradVn>XMIC</TradVn> … </Tx> … </New> </Tx>
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-09T09:30:42.124Z’	
29	Kauplemisvolituse d	‘AOTC’	
33	Hind	‘0.352’	
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	

See tehinguaruanne on sama kui tehinguaruanne, mis oleks tulnud esitada, kui investeerimisühing X oleks sooritanud kliendikorralduste sobitamistehingu, v.a teistsugune kirje kauplemisvolituste väljal.

5.2.4 Kauplemisvolituste piirangud

Oma arvel kauplevad või kliendikorralduste sobitamistehinguid sooritavad investeerimisühingud tegutsevad ise ja vahetult ega saa „edastada korraldusi“ vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 4, sest korraldused, mis nad esitavad teisele ühingule või investeerimisühingule, on nende enda korraldused ning tegu ei ole kliendilt saadud korralduste edastamisega ega korraldustega, mille aluseks on otsus kliendi nimel finantsinstrumendi hankimiseks või võõrandamiseks kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel. Seega kui investeerimisühingud edastavad korraldusi, kuid ei vasta komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimustele, eeldab ESMA neilt aruandeid üksnes „muu volituse alusel“.

Nagu mainitakse punktis 5.28, peaks otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja esitama aruanded muu volituse alusel või kliendikorralduste sobitamise teel tegutsejana.

5.3 Aruandlusahelad ja edastamine

5.3.1 Üldist

Aruandlusahel tekib, kui ühing või investeerimisühing ei täida korraldust ise, vaid saadab korralduse täitmiseks teisele ühingule või investeerimisühingule, näiteks järgmistes olukordades:

(i) ühing või investeerimisühing saadab oma korralduse täitmiseks ühingule;
(ii) ühing või investeerimisühing saadab oma kliendilt saadud korralduse täitmiseks teisele ühingule või investeerimisühingule või
(iii) otsustab hankida või võõrandada finantsinstrumendi kooskõlas oma kliendilt saadud kaalutlusõigusel põhineva volitusega ning esitab selleks korralduse teisele ühingule või investeerimisühingule.

Kui tegu ei ole korralduse edastamisega komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 tähenduses, ei mõjuta investeerimisühingu kuulumine aruandlusahelasse tema aruandluskohustusi rohkem kui see, et tema tehinguaruanded ahelas, milles korraldust komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 4 mittevastaval viisil edastatakse, peaksid kajastama kogust ning sooritamise hinda, kuupäeva ja kellaaega, mille on talle teatanud tema korralduse täitnud ühing või investeerimisühing (vt punkt 5.27.1.2). Investeerimisühing peaks aruande esitama üksnes oma positsiooni kohta ahelas ega pea seega vaatama ahelas oma vahetust vastaspoolest või kliendist kaugemale edasi ega tagasi. Investeerimisühingu aruanded ahelas, milles investeerimisühing tegutseb eelmiste punktide ii ja iii alapunktis kirjeldatud viisil ning milles komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud nõuded ei ole täidetud, on samad [20] kui siis, kui investeerimisühing kaupleb tehingu sooritamiseks otse koha või turu vastaspoole või kliendiga (vt suuniste III osa punkt 5.26.2).

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 edastamistingimusi ei kohaldata ühingutele. Seega kui investeerimisühing saab korralduse ühingult, peaks ta aruandesse ostja/müüjana märkima korralduse saatnud ühingu, mitte selle ühingu aluseks oleva kliendi. Seda tehtaks korralduste puhul, mis saadakse investeeringuid haldavalt ühingult, mis ei ole investeerimisühing. Vastuvõttev investeerimisühing peaks kliendiks (ostjaks/müüjaks) märkima investeeringuid haldava ühingu, mitte tema aluseks olevad fondid/kliendid.

[20] Samas täidetakse korralduse indikaatori edastamise väli teistmoodi.

5.3.2 Ahel, milles ühing kaupleb oma arvel või kliendikorralduste sobitamistehingutega

Oma arvel kauplevad või kliendikorralduste sobitamistehinguid sooritavad investeerimisühingud tegutsevad ise ja vahetult ning neid ei käsitata edastavate investeerimisühingutena, sest korraldused, mida nad teisele ühingule või investeerimisühingule esitavad, on nende enda korraldused ning tegu ei ole kliendilt saadud korralduste edastamisega ega korraldustega, mille aluseks on otsus kliendi nimel finantsinstrument omandada või võõrandada kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel. Näited on suuniste III osa punktis **Error! Reference source not found.**.

5.3.3 Edastamine

Investeerimisühingud, kes tegutsevad eespool punkti 5.3.1 ii või iii alapunktis märgitud viisil, võivad valida, kas täita komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamistingimused või esitada tehinguaruanne.

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 3 lõikes 2 on sätestatud, et „investeerimisühing ei ole tehingut sooritanud, kui ta on edastanud korralduse vastavalt artiklile 4“. Vastuvõttev ühing peaks esitama väljade tabelis märgitud teabe enda tehinguaruandes. Vastuvõttev ühing peaks seda tegema oma tavapärase aruandluse raames ega pea hakkama tunnustatud aruandlussüsteemi pakkujaks.

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 kohaselt (väljad 7, 16 ja 25) peaks investeerimisühing, kes tegutseb punkti 5.3.1 ii või iii alapunktis märgitud viisil ega vasta sama määruse artiklis 4 sätestatud edastamistingimustele, esitama tehingu kohta aruande ning märkima korralduse indikaatori edastamise väljale ‘true’. Vastuvõttev investeerimisühing peaks märkima saatva investeerimisühingu aruandes ostjaks/müüjaks. Kui edastava investeerimisühingu kliendil on aruandluskohustus, peaks klient märkima oma aruandesse ostja/müüjana edastava investeerimisühingu, mitte vastuvõtva investeerimisühingu (nagu on näidatud punktis 5.26.3.3).

Kui investeerimisühing sooritab kliendikorralduste sobitamistehinguid või oma arvel tehinguid kauplemiskohas, mis ei ole organiseeritud kauplemissüsteem, ei ole ta edastaja, sest ta ei saada korraldust investeerimisühingule, vaid täidab selle ise vahetult kauplemiskohas, mistõttu väljale 25 tuleks märkida ‘false’.

Edastamisnõudeid kohaldatakse põhimõttel „kõik või mitte ükski“, mis tähendab, et kui korralduse saatjaks olev ühing ei saada edasi ka kogu komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 edastamistingimustele vastavuseks vajalikku teavet, peaks vastuvõttev investeerimisühing esitama aruande nii, nagu ei oleks edastamist toimunud.

Kui toimub komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 kohane edastamine, ei muuda see sama määruse artikli 14 kohaldamist, seega peaks vastuvõttev investeerimisühing saatma kõik aruanded oma asukoha pädevale asutusele.

Edastamist ei toimu sama investeerimisühingu eri filiaalide vahel, sest need ei ole eraldi juriidilised isikud. Seevastu kui toimub edastamine kontserni kuuluvate eri juriidiliste isikute vahel, kohaldatakse neile samu aruandlusnõudeid kui investeerimisühingutele või ühingutele, kes ei ole omavahel seotud.

Välja 25 (korralduse indikaatori edastamine) eesmärk on näidata, kas ahelas toimus teisele investeerimisühingule edastamine komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 tingimusi

täitmata. Agendilepingu alusel tegutsev edastav investeerimisühing peaks väljale 25 märkima ‘true’ olenemata sellest, kas ta püüdis edastada, kuid see ei õnnestunud, või otsustas mitte edastada.

Seda arvestades on välja 25 täitmisel võimalikud järgmised variandid:

i) Kui investeerimisühing edastab ning vastab kõigile artiklis 4 sätestatud tingimustele, ei esita ta aruannet.

ii) Kui investeerimisühing kaupleb otse kauplemiskohas, mis ei ole organiseeritud kauplemissüsteem sooritamas kliendikorralduste sobitamistehinguid oma arvelt, tuleks väljale 25 (korralduse indikaatori edastamine) märkida „false“.

iii) Kui investeerimisühing tegutseb oma arvel või sooritab kliendikorralduste sobitamistehingut (väli 29 = ‘DEAL’/‘MTCH’), tuleks väljale 25 (korralduse indikaatori edastamine) märkida ‘false’.

iv) Kui investeerimisühing edastab otseselt kliendi korraldusi ning või sisestab korraldusi kliendilt saadud kaalutlusõigusel põhineva mandaadi alusel ning ei vasta artikli 4 tingimustele, peaks ta aruandesse märkima, et kaupleb muu volituse alusel (väli 29 = ‘AOTC’), ning väljale 25 märkima ‘true’.

v) Kõigil muudel juhtudel, kus investeerimisühing kaupleb muu volituse alusel (väli 29 = ‘AOTC’), tuleks väljale 25 märkida ‘false’.

5.4 Tehingu sooritamine kauplemiskohas

Välja 36 täitmisel tuleks tehing lugeda kauplemiskohas sooritatuks üksnes siis, kui:

vi) kahe poole ostu- ja müügihuvi kaalutlusõigusega või kaalutlusõiguseta kokkuviijaks on kauplemiskoht

või

vii) kahe poole ostu- ja müügihuvi kaalutlusõigusega või kaalutlusõiguseta kokkuviijaks ei ole kauplemiskoht, kuid tehing kuulub siiski selle kauplemiskoha eeskirjade alla ning sooritatakse nende eeskirjade järgi.

Kui investeerimisühing vahetult turul ei tegutse, ei loeta teda tehinguaruandluses kauplemiskohas tehingute sooritajaks.

5.4.1 Kauplemiskoha tehingu tunnuskood (väli 3)

Vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 artiklile 12 „peavad kauplemiskohtade korraldajad määrama unikaalse kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi“ igale tehingule, mille aluseks on tema korralduste kokkuviimise süsteemi läbinud korralduse täielik või osaline täitmine. Seda kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi (TVTIC) kasutatakse komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 väljal 3, kuhu investeerimisühingud peavad märkima „kauplemiskohas sooritatud tehingu turupoole puhul“ kauplemiskoha korraldaja genereeritud vastava kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi.

Kauplemiskohtade korraldajad võivad genereerida kauplemiskoha tehingu tunnuskoodid ka tehingutele, mis on vastavalt ii alapunktile sooritatud selles kauplemiskohas. Kui sellistes olukordades genereeritakse tehingule kauplemiskoha tehingu tunnuskood ja investeerimisühing saab

kauplemiskohalt tehingu tunnuskoodi, võib investeerimisühing otsustada märkida kauplemiskoha korraldaja genereeritud tehingu tunnuskoodi komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 väljale 3.

5.4.2 Koha välja täitmine ahelate korral (väli 36)

Kui tehinguaruanne esitatakse tehingu kohta, mis on sooritatud kauplemiskohas vastavalt ülal punktis 5.4 selgitatule, kliendi korralduste süsteemse täitjaga või liiduvälisel organiseeritud kauplemisplatvormil, tuleks turupoole aruandes väljale 36 märkida koha, kauplemisplatvormi või süsteemse täitja MIC-kood. Kõigis teistes ahela aruannetes tuleks märkida 'XOFF'.

5.5 Poolte tunnuskoodid

Isikud, kellele on võimalik määrata LEI, tuleb tähistada LEI-ga vastavalt MiFIRi artikli 26 lõikele 6 ning komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 5 ja I lisale. Sellised isikud on eelkõige partnerlused, ühingud, liidud ja füüsilised isikud, kellel on majandustegevus.[21] Filiaali korral tuleks märkida peakontori LEI, ehkki teatud juhtudel võib olla võimalik määrata LEI ka filiaalidele.[22]

Kuigi tehinguid sooritavad investeerimisühingud peaksid vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 5 lõikele 2 tagama, et nende LEI oleks ajakohastatud vastavalt juriidilise isiku ülemaailmse tunnuse süsteemi akrediteeritud kohaliku tegevusüksuse tingimustele, ei kohusta artikli 13 lõige 3 neid tagama, et uuendatud oleks ka kliendi või vastaspoole LEI.

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 6 on sätestatud, et füüsiline isik tuleks tähistada sama määruse II lisas märgitud riigisisese isikukoodiga. Oluline on arvestada, et vastavalt MiFIRi artikli 26 lõikele 1 peavad investeerimisühingud esitama aruannetes tehingute kohta õiged ja täpsed üksikasjad. Et füüsiliste isikute isikukoodid sisalduvad konkreetse tehingu kohta esitatavas aruandes, kehtib aruannetes õigete ja täpsete üksikasjade esitamise kohustus ka füüsiliste isikute isikukoodidele. Selle nõude täitmiseks võivad investeerimisühingud näiteks paluda füüsilisel isikul esitada ametlikke dokumente, mis tõendavad isikukoodi õigsust ja kehtivust. Kui klient isikukoodi ei anna, ei saa investeerimisühing selle teabe suhtes tehinguaruandluse nõudeid täita.

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 6 lõikes 3 ei käsitleta olukorda, kus füüsilisel isikul on mitme EMP-välise riigi kodakondsus. Sellised juhtumid tuleks lahendada sama sortimismenetlusega, mida kasutatakse mitme EMP riigi kodakondsuse korral.

5.5.1 CONCAT-koodi genereerimise kord

CONCAT-koodi ei tohiks kasutada vaiketunnusena ning seda ei tohiks mingil juhul kasutada riikide korral, mis vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 II tabelile ei ole valinud CONCAT-koodi üheks kolmest eelistatud võimalusest.

---

[21] Füüsilised isikud, kellel on majandustegevus, loetakse investeerimisühinguteks teatud tingimustel, mis on määratletud MiFIDi artikli 4 lõike 1 punktis 1. Üksikasjalikum teave selle kohta on LEI regulatiivse järelevalvekomitee teatises majandustegevusega füüsiliste isikute kohta (http://www.leiroc.org/publications/gls/lou_20150930-1.pdf).

[22] Vastavalt LEI regulatiivse järelevalvekomitee 11. juuli 2016 teatisele võib teatises sätestatud tingimustel olla võimalik määrata LEI ka teatud filiaalidele. Üksikasjalikum teave on LEI regulatiivse järelevalvekomitee teatises (http://www.leiroc.org/publications/gls/roc_20160711-1.pdf).

CONCAT-koodi koostamiseks tuleks kasutada järgmist neljaastmelist meetodit.

1. Ees- ja perekonnanime leidmine

Varieeruva kirjapildi või lühendikasutuse riski minimeerimiseks peaks investeerimisühing tagama, et isiku kogu nimi on kirjutatud õigesti. Mis tahes lühivormide ja lühendite kasutamine on keelatud.

2. Tiitlite kustutamine

Kõik tiitleid, ametikohti, kutsealasid või akadeemilisi kvalifikatsioone tähistavad eesliited tuleb nimede juurest kustutada. Tiitlid on näiteks järgmised, nii suur- kui ka väiketähtedega:

atty, coach, dame, dr, fr, gov, honorable, madam(e), maid, master, miss, monsieur, mr, mrs, ms, mx, ofc, ph.d, pres, prof, rev, sir.

3. Eesliidete kustutamine

Am, auf, auf dem, aus der, d, da, de, de l', del, de la, de le, di, do, dos, du, im, la, le, mac, mc, mhac, mhíc, mhic giolla, mic, ni, ní, níc, o, ó, ua, ui, uí, van, van de, van den, van der, vom, von, von dem, von den, von der.

Perekonnanimede eesliiteid, mida ei ole eespool loetletud, või nimes sisalduvaid eesliiteid, st McDonald, MacChrystal, O'Brian, O'Neal, ei kustutata; järgmises etapis kustutatakse neist siiski ülakomad. Eespool esitatud loetelu kehtib nii suurte kui ka väikeste algustähtede korral.

4. Ülakomade, rõhumärkide, sidekriipsude, kirjavahemärkide, tühikute jms transliteratsioon

Ees- ja perekonnanime iga täht tuleb translitereerida järgmise tabeli järgi. Kokkuvõttes jäetakse translitereerimata üksnes ladina tähestiku tähed A–Z ja a–z ning kustutatakse kõik diakriitilised märgid, ülakomad, sidekriipsud, kirjavahemärgid ja tühikud.

Translitereerimistabel

Alljärgnevas tabelis on ühekaupa esitatud sisend- ja väljundsümbolid. Tabeli abil translitereeritakse ees- ja perekonnanimi enne esimese viie tähe võtmist vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 6 lõikele 4.

Kirillitsas, kreeka või muus mitteladina tähestikus kirjutatud nimede korral, mille ladina tähestikuga vorm puudub, tuleb kasutada translitereeritud ingliskeelset nimeversiooni lähtuvalt vastava tähestiku tavadest.

Väljund	Sisend	Sisendi Unicode-koodid
A	Ä ä À à Á á Â â Ã ã Å å Ă ă Ą ą Ă ă Æ æ	U+00C4 U+00E4 U+00C0 U+00E0 U+00C1 U+00E1 U+00C2 U+00E2 U+00C3 U+00E3 U+00C5 U+00E5 U+01CD U+01CE U+0104 U+0105 U+0102 U+0103 U+00C6 U+00E6
C	Ç ç Ć ć Ĉ ĉ Č č	U+00C7 U+00E7 U+0106 U+0107 U+0108 U+0109 U+010C U+010D
D	Ď đ Đ ď ð	U+010E U+0111 U+0110 U+010F U+00F0

E	È è É é Ê ê Ë ë Ĕ ĕ Ę ę	U+00C8 U+00E8 U+00C9 U+00E9 U+00CA U+00EA U+00CB U+00EB U+011A U+011B U+0118 U+0119
G	Ĝ ĝ Ģ ģ Ğ ğ	U+011C U+011D U+0122 U+0123 U+011E U+011F
H	Ĥ ĥ	U+0124 U+0125
I	Ì ì Í í Î î Ï ï ı	U+00CC U+00EC U+00CD U+00ED U+00CE U+00EE U+00CF U+00EF U+0131
J	Ĵ ĵ	U+0134 U+0135
K	Ķ ķ	U+0136 U+0137
L	Ĺ Í Ļ ļ Ł ł Ľ ľ	U+0139 U+013A U+013B U+013C U+0141 U+0142 U+013D U+013E
N	Ñ ñ Ń ń Ň ň	U+00D1 U+00F1 U+0143 U+0144 U+0147 U+0148
O	Ö ö Ò ò Ó ó Ô ô Õ õ Ő ő Ø ø Œ œ	U+00D6 U+00F6 U+00D2 U+00F2 U+00D3 U+00F3 U+00D4 U+00F4 U+00D5 U+00F5 U+0150 U+0151 U+00D8 U+00F8 U+0152 U+0153
R	Ŕ ŕ Ř ř	U+0154 U+0155 U+0158 U+0159
S	ß ß Ś ś Ŝ ŝ Ş ş Š š Ș ș	U+1E9E U+00DF U+015A U+015B U+015C U+015D U+015E U+015F U+0160 U+0161 U+0218 U+0219
T	Ť ť Ţ ţ Þ þ Ț ț	U+0164 U+0165 U+0162 U+0163 U+00DE U+00FE U+021A U+021B
U	Ü ü Ù ù Ú ú Û û Ű ű Ũ ũ Ų ų Ů ů	U+00DC U+00FC U+00D9 U+00F9 U+00DA U+00FA U+00DB U+00FB U+0170 U+0171 U+0168 U+0169 U+0172 U+0173 U+016E U+016F
W	Ŵ ŵ	U+0174 U+0175
Y	Ý ý Ÿ ÿ Ŷ ŷ	U+00DD U+00FD U+0178 U+00FF U+0176 U+0177
Z	Ź ź Ž ž Ż ż	U+0179 U+017A U+017D U+017E U+017B U+017C
{DELETE}	Kõik tähed peale a–z ja A–Z, mida ei ole eespool loetletud, tuleb kustutada.	

Valitud näited

Need näited kehtivad üksnes siis, kui riiklik tunnus on CONCAT. Enamiku riikide kohta eeldatakse kõrgema astme tunnuste kasutamist (komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 6 lõige 2).

Eesnimi (-nimed)	Perekonnanimi (-nimed)	Riigitähis + CONCAT	Märkus
John	O'Brian	IE19800113JOHN#OBRIA	„John" pikendati vahemärgiga 5-täheliseks. O' on nime osa, seda ei translitereerita. Ülakoma kustutati.
Ludwig	Van der Rohe	HU19810214LUDWIROHE#	Eesliide „van der" kustutati.
Victor	Vandenberg	US19730322VICTOVANDE	„Van" on nime osa, seda ei loeta eesliiteks.
Eli	Ødegård	NO19760315ELI##ODEGA	„Eli" pikendati vahemärkidega 5-täheliseks. Ø translitereeriti O-ks ja å A-ks.
Willeke	de Bruijn	LU19660416WILLEBRUIJ	Eesliide „de" kustutati.
Jon Ian	Dewitt	US19650417JON##DEWIT	„Jon" pikendati vahemärkidega 5-täheliseks. „Ian" jäeti kõrvale, kasutada tuleb üksnes esimest

			eesnime. Nimes „Dewitt“ ei ole „De“ eesliide.
Amy-Ally	Garção de Magalhães	PT19900517AMYALGARCA	Eesnimest kustutati sidekriips. Tähed translitereeriti.
Giovani	dos Santos	FR19900618GIOVASANTO	Eesliide kustutati.
Günter	Voß	DE19800715GUNTEVOS##	Ü translitereeriti U-ks ja ß S-iks.

5.5.2 Eesnimi (-nimed) ja perekonnanimi (-nimed)

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabeli 2 kõigi nende väljade täitmiseks, kus nõutakse eesnime (-nimesid) või perekonnanime (-nimesid), tuleks kohaldada üksnes punktis 5.5.1 „CONCAT-koodi genereerimise kord“ kirjeldatud 1. etappi („Ees- ja perekonnanime leidmine“) ning 2. etappi („Tiitlite kustutamine“). Seega translitereerimist ei kasutata ja eesliiteid ei kustutata. Kasutada võib kõiki ELi liikmesriigis kasutatavaid sümboleid, sealhulgas diakriitiliste märkidega variante. Kõik eesliidete, eesnimede ja perekonnanimede tähed peaksid olema suurtähed.

5.6 Tehingu mõiste

5.6.1 Omandamised ja võõrandamised

Nagu selgitati 1. ploki sissejuhatuses, huvitavad finantsinstrumentide omandi üleminekud pädevaid asutusi seoses turukuritarvitustega. Liikumiste kohta, millega omandi üleminekut ei kaasne, aruandeid ei esitata. Selline liikumine on näiteks liikumine kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel hallatavalt kliendikontolt tehingukontole.

Erandiks on komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõikes 4 märgitud samaaegne omandamine ja võõrandamine kauplemisjärgse avaldamise korral. Seda kohaldatakse olukorras, kus investeerimisühing täidab kauplemiskoha tellimusraamatus iseenda korralduse. Selles olukorras teatamise näide on punktis 5.14.3.

5.6.2 Aruandluskohustuse erandid

5.6.2.1 Artikli 2 lõike 5 punkti a kohased erandid

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõike 5 punkti a korral tuleks arvestada järgmisi näiteid.

6. näide

Kaks investeerimisühingut sõlmivad repolepingu riigivõlakirja suhtes. Üks investeerimisühing esitab tehingu kohta aruande vastavalt väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute määrusele.

Tehingu korral ei ole kummalgi investeerimisühingul aruandluskohustust, sest tehingu kohta on juba esitatud aruanne vastavalt väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute määrusele.

7. näide

Investeerimisühing, kes tegutseb ühiseks investeerimiseks loodud ettevõtjana kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel, sõlmib repolepingu riigivõlakirja suhtes. Eeldatakse, et fondil on väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute määruse kohaselt aruandluskohustus ja investeerimisühingul mitte.

Investeerimisühingul MiFIRist tulenev aruandluskohustus puudub, sest tehingu kohta on esitatud aruanne väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute määruse alusel.

5.6.2.2 Artikli 2 lõike 5 punkti b kohased erandid

Tehingusiseste ülekande- või maksejuhistega seoses ei ole kliiringu ja/või arveldusega tegelevatel vastaspooltel (sh väärtpaberite keskdepositooriumidel) komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõike 5 punkti b alusel aruandluskohustust, aruande peab esitama üksnes tehingu sooritanud investeerimisühing.

Ka kliiritava börsivälise lepingu korral ei pea teisteks kliiritud lepinguteks uuendamise kohta esitama aruannet.

5.6.2.3 Artikli 2 lõike 5 punkti d kohased erandid

8. näide

Hoidmisühing / esindajakonto omanik otsustab finantsinstrumente üle viia ühest depoopangast teise.

Finantsinstrumentide sellise üleviimise korral aruandluskohustus puudub, sest tegevus on seotud üksnes hoidmisühingu toimingutega.

9. näide

Klient kannab hoidmisühingule / esindajakonto omanikule üle finantsinstrumente oma hoidmis-/esindajakontol hoidmiseks.

Sellise ülekande korral aruandluskohustus puudub, sest ülekanne on seotud üksnes hoidmisühingu toimingutega.

5.6.2.4 Artikli 2 lõike 5 punkti e kohased erandid

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõike 5 punkti e järgi ei kuulu tehingute alla kauplemisjärgsed reserveeringud ja tuletislepingute uuendused, mille korral asendab tuletislepingu ühe poole kolmas isik. Seega ei pea aruannet esitama lepingu ennetähtaegse lõpetamise korral, kui põhjuseks on kliirimine ja sellele järgnev lepingu uuendamine, mille tulemusena asendab lepingu algse poole teine isik.

5.6.2.5 Artikli 2 lõike 5 punkti g kohased erandid

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõike 5 punkti g järgi ei kuulu tehingute alla „*ühisinvesteerimisettevõtja osakute emiteerimine või lunastamine ühisinvesteerimisettevõtja halduri poolt*“.

Börsil kaubeldavate fondide korral ei pea tehinguaruannet esitama ühisinvesteerimisettevõtja osaku emiteerimise või lunastamise korral, mis toimub volitatud osalise ja ühisinvesteerimisettevõtja halduri

vahel. See protsess hõlmab toiminguid, kus volitatud osaline annab ühisinvesteerimisettevõtja haldurile ühisinvesteerimisettevõtja moodustamise aluseks olevad finantsinstrumendid ning saab vastu ühisinvesteerimisettevõtja osaku (emiteerimine). Sama erand kehtib ka vastupidise protsessi korral (lunastamine). Selle tegevuse suhtes kehtib erand, sest see on haldusprotsess, kus vahetatakse majandusekvivalente ja turukuritarvituse risk on minimaalne.

Investeerimisühing ostab ühisinvesteerimisettevõtja osakuid, kes võib olla või mitte olla börsil kaubeldav fond, otse ühisinvesteerimisettevõtja valitsejalt või haldurilt ühisinvesteerimisettevõtja prospektis määratud hinnaga. Tehingu sisuks on osakute emiteerimine, mistõttu investeerimisühing ei pea esitama selle kohta aruannet. Ka siis, kui tehinguks on investeerimisühingu poolne müük samadel tingimustel, ei pea aruannet esitama, sest tegu on osakute lunastamisega.

See erand kehtib üksnes ühisinvesteerimisettevõtja halduriga toimuva emiteerimis-/lunastamisprotsessi kohta. Pärast osaku loomist tuleks osaku kõigi ostude ja müükide (sh turuväliste) kohta esitada aruanne, olenemata sellest, kas omandamis- või võõrandamishind vastab vara puhasväärtusele.

10. näide

Investeerimisühing X (volitatud osaline) soovib omandada ühisinvesteerimisettevõtja haldurilt uusi ühisinvesteerimisettevõtja osakuid, et rahuldada klientide nõudlust osakute järele.

Kui investeerimisühing X peab emiteerimisprotsessi sooritamiseks omandama järelturult aluseks olevad finantsinstrumendid, millest ühisinvesteerimisettevõtja on moodustatud, tuleb nende alusfinantsinstrumentide omandamise kohta esitada tehinguaruanded, kui alusfinantsinstrumendid kuuluvad artikli 26 lõike 2 järgi aruandekohustuse alla.

Kui investeerimisühing X teeb seejärel mitterahalise vahetustehingu ühisinvesteerimisettevõtjaga, vahetades aluseks olevad finantsinstrumendid uute osakute vastu, ei pea investeerimisühing X ega ühisinvesteerimisettevõtja selle tehingu kohta esitama aruannet, sest tegu on emiteerimisprotsessi osaga.

5.6.2.6 Artikli 2 lõike 5 punkti h kohased erandid

Finantsinstrumentide, näiteks optsioonide, optsioonivõlakirjade, vahetusvõlakirjade, jaotamis- või märkimisõiguse realiseerimisega finantsinstrumendi omaniku poolt ei kaasne aruandluskohustust optsiooni realiseerivale investeerimisühingule ega investeerimisühingule, kelle suhtes see realiseeritakse.[23] Kui realiseerimise tulemusena antakse üle muu finantsinstrument, kaasne ka sellega aruandluskohustust optsiooni realiseerivale investeerimisühingule ega investeerimisühingule, kelle suhtes see realiseeritakse.

11. näide

Investeerimisühing X realiseerib finantsinstrumendi, mille realiseerimise korral puudub aruandluskohustus.

[23] Realiseerimine hõlmab ka börsil kaubeldavaid tuletisinstrumente, mille korral on investeerimisühing või selle klient määratud üleandmisprotsessis instrumente üle andma, ning teise poole täitmisjuhiste alusel sooritavad tehingu aluseks olevate instrumentidega keskne vastaspool ja/või tema kliirivad liikmed.

Kui investeerimisühing X realiseerib finantsinstrumendi ja saab raha asemel selle aluseks olevad finantsinstrumendid, ei pea alusfinantsinstrumendi sel viisil omandamise kohta samuti esitama aruannet.

Kui investeerimisühing X realiseerib finantsinstrumendi ja peab valima, kas saada raha või aluseks olevad finantsinstrumendid, ei pea selle kohta esitama aruannet.

12. näide

Finantsinstrumendi või vahetusvõlakirja omanik realiseerib finantsinstrumendi või vahetusvõlakirja. Realiseerimise või vahetuse tulemusena omandab või võõrandab investeerimisühing X (kes on realiseerimise või vahetuse vastaspool) aluseks olevaid finantsinstrumente (nt kauplemiskohas), et anda need instrumendid üle õigustatud isikule.

Aluseks olevate finantsinstrumentide omandamise/võõrandamise (nt kauplemiskohas omandamise) kohta tuleks esitada tehinguaruanne (-aruanded). Samas ei kuulu aruandluskohustuse alla nimetatud aluseks olevate finantsinstrumentide õigustatud isikule üleandmine või finantsinstrumendi realiseerimine/vahetamine.

5.6.2.7 Artikli 2 lõike 5 punkti i kohased erandid

Artikli 2 lõike 5 punkti i kohase erandi korral kehtib piirang, mille kohaselt esmase avaliku pakkumise, avaliku järelpakkumise, suunatud pakkumise või võlakirjade emiteerimise korral tuleks artikli 2 lõike 5 punkti i tegevuste kohta esitada aruanne.

Artikli 2 lõike 5 punkti i kohane erand hõlmab finantsinstrumentide lõppemist lunastus- või lõpptähtpäeval.

Kui omandamine või võõrandamine toimub seoses ühinemiste, ülevõtmiste, nõukogu määruse (EÜ) nr 1346/2000[24] kohaste maksejõuetusmenetluste, aktsiatükelduste või pöördsplittidega, ei pea nende kohta esitama aruannet. Neil juhtudel eelmääratakse tingimused tavaliselt aktsionäride koosolekul ja avaldatakse vastava teate vormis ning investorid kuuluvad selle kokkuleppe alla muid otsuseid tegemata.

Aktsiadividendide jaotamise kohta ei pea aruannet esitama, v.a eespool nimetatud piirangu puhul, sest sel juhul tekivad finantsinstrumendid eelmääratud tingimustel ning investor ei tee instrumentide tekkimise ajal investeerimisotsust.

Ka nimiväärtuse automaatne suurenemine või vähenemine amortisatsioonigraafikute tõttu ei kuulu aruandekohustuse alla, sest selle tingimused on määratud juba algse lepingu sõlmimisel ning nimiväärtuse vähenemise/suurenemise ajal otsust ei tehta.

Juhtudel, kus investor teeb otsuse tekkimise ajal, tuleb lõppemise või lunastamise kohta esitada aruanne. Sellised on näiteks juhtumid, kus klient otsustab ülevõtmispakkumise käigus võtta vastu raha või instrumente või kui emitent saab valida, kas anda üle raha või finantsinstrumente.

13. näide

[24] Nõukogu 29. mai 2000. aasta määrus (EÜ) nr 1346/2000 maksejõuetusmenetluse kohta.

Investeerimisühing X omab äriühingu võlakirju, mille lunastustähtaeg on 5 aastat. Emissioonitingimuste kohaselt on äriühingul õigus lunastada osa võlakirju enne tähtaega. 3. aastal lunastab äriühing osa võlakirjaemissiooni nominaalväärtusest.

Võlakirjade tagasiostmine ei kuulu aruandluskohustuse alla põhjusel, et tagasiostmine toimub vastavalt eelmääratud lepingutingimustele, mida investor (investeerimisühing X) ei saa mõjutada.

5.6.2.8 Artikli 2 lõike 5 punkti l kohased erandid

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõike 5 punkti l järgi ei kuulu tehingute alla „*dividendide reinvesteerimise plaani alusel toimunud omandamine*“.

Dividendide reinvesteerimise programm või dividendide reinvesteerimise kava (DRIP) on aktsiainvesteeringu liik, mille puhul investor otsustab juba alguses, et ei soovi saada dividende rahas, vaid reinvesteerida oma dividendid otse alusaktsiasse.

Lisaks kirjeldatule puudub tehinguaruandluse kohustus ka nimetatud aktsiate omandamisel.

5.6.2.9 Artikli 2 lõike 5 punkti m kohased erandid

See erand ei kehti plokk-korralduste aruandluse kohta (turul toimuvad ühised omandamised või võõrandamised klientide nimel kogumisinvesteeringute raames ja investeeringute realiseerimise kavad), sest omandamised ja võõrandamised toimuvad küll kava alusel, ent omandamise või võõrandamise ajal tehakse teatud otsus, mistõttu kõik erandite tingimused ei ole täidetud.

14. näide

Äriühing pakub oma töötajatele aktsiaostuoptsiooni programmi alusel, kus omandatavate aktsiate kogus vastab 3%-le töötaja aastapalgast, aktsiad ostetakse iga kvartali viimasel päeval soodus-turuhinnaga ning töötaja peab teatama ostuotsuse hiljemalt eelmise kuu lõpus.

Äriühing sõlmib investeerimisühinguga X lepingu aktsiate jaotamiseks töötajatele ja äriühingu nimel korrespondentpangana maksete vastuvõtmiseks.

Töötaja otsustab märtsis osta programmi raames aktsiaid 350 euro eest (turuhind). Samuti osaleb töötaja programmis septembris 375 euro eest ja detsembris 400 euro eest.

Investeerimisühingul X puudub märtsi, septembri ja detsembri tehingute korral aruandluskohustus, sest ühegi omandamise väärtus ei ületa 500 eurot kuus ning tegu ei ole programmi raames toimuva ühekordse tehinguga, ehkki kogusumma on üle 1000 euro.

5.6.2.10 Artikli 2 lõike 5 punkti n kohased erandid

15. näide

Äriühing teeb investoritele pakkumuse oma võlakirjade tagasiostmiseks lisaintressiga. Pakkumuse tingimused olid varem avaldatud teates või prospektis. Äriühing sõlmib investeerimisühinguga X lepingu, et see tegutseks haldurina.

Investeerimisühingul X ja investoritel puudub tehinguaruandluse kohustus, sest tingimused olid varem avaldatud ja investoritel oli võimalik üksnes valida, kas pakkumusega nõustuda või mitte.

5.7 Aruandlusmehhanismid

Suuniste I lisas on kirjeldatud, kuidas pädevad asutused töötlevad esitajatelt laekunud aruandeid.

5.7.1 Mittekohaldatavad väljad ja instrumentide võrdlusandmete väljade täitmine

Kui väljade tabelis on märgitud, et konkreetset välja selle välja kirjelduses või aadressilhttps://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1521_mifir_transaction_reporting_technical_reporting_instructions.pdf avaldatud kontrolltabelis määratletud tingimustel ei kohaldata, ei peaks seda välja täitma ning aruanne tuleks tagasi lükata, kui see ei läbi ESMA veebilehel olevas tabelis sätestatud kontrolle. Näiteks kui ühing märgib aruandes, et tehing sooritati algoritmi abil, ei peaks täitma välja 60 (täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik).

Võrdlusandmete sisestamise korral on olukord mõneti teistsugune. Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabelis 2 on sätestatud, et välju 42–56 (instrumentide viidete väljad) ei kohaldata tehingute korral, mis sooritatakse kauplemiskohas või kui investeerimisühing tegutseb kliendi korralduste süsteemse täitjana või kui väljal 41 investeerimisühingu esitatud ISIN-koodile vastavad võrdlusandmed sisalduvad ESMA võrdlusandmete loendis. Kui üks neist tingimustest on täidetud, ei pea investeerimisühingud neid välju täitma. Samuti eeldab ESMA, et kõik teised samal kauplemiskuupäeval instrumendiga sooritatud tehingud, millest vähemalt ühe sooritas sel kauplemiskuupäeval investeerimisühing ise kauplemiskohas või kliendi korralduste süsteemse täitjana tegutseva investeerimisühinguga, vastavad tabelis 2 sätestatud tingimustele ning instrumentide võrdlusandmete välju ei ole sellise tehingu korral vaja täita.

16. näide

Investeerimisühing X ostab kauplemiskohas instrumendi Y ning müüb instrumendi Y samal päeval börsiväliselt teisele investeerimisühingule või ühingule. Instrument Y ei sisaldu ESMA avaldatud võrdlusandmete loendis.[25] Ost toimus kauplemiskohas, mistõttu ostutehingu aruandes ei ole vaja täita instrumendi võrdlusandmete välju. Müügitehing neile tingimustele otseselt ei vasta, sest kauplemine ei toimunud kauplemiskohas, ent kuna ostutehing sooritati samal päeval kauplemiskohas, ei ole ka müügitehingu aruandes vaja täita instrumendi võrdlusandmete välju.

Kui need tingimused ei ole täidetud, peaksid investeerimisühingud täitma kõik instrumendi suhtes asjakohased väljad 42–56.

Pädevad asutused ei peaks tehinguaruannet siiski tagasi lükkama, kui investeerimisühingud on täitnud instrumendi võrdlusandmete väljad olukorras, kus instrumendiga kaubeldakse kauplemiskohas või see sisaldub ESMA loendis.

[25] Ebatõenäolisel juhul, kui kauplemiskoht jätab instrumendi võrdlusandmed saatmata.

5.7.2 Tehinguaruannete esitamine

Vastavalt MiFIRi artikli 26 lõikele 7 võib investeerimisühing lasta kauplemiskohal esitada kauplemiskohas sooritatud tehingu turupoole andmed. Samuti võivad kauplemiskohad pakkuda tehingu kliendipoole andmete teatamise teenust tehingute korral, mida ei sooritata nende süsteemide kaudu, juhul kui nad registreerivad end tunnustatud aruandlussüsteemi pakkujaks.

Kui kauplemiskoht esitab aruandeid investeerimisühingu nimel, peaks ta olenemata kauplemiskoha asukohast esitama teabe sellele pädevale asutusele, kellele peaks teabe esitama ka esindatav investeerimisühing.

Kui kauplemiskoht esitab aruanded ühingu MiFIRi artikli 26 lõike 5 kohaselt sooritatud tehingute kohta, peaks ta esitama teabe oma asukoha pädevale asutusele.

5.7.2.1 Tehinguaruannete esitamise tähtaeg

5.7.2.1.1 Aruandluse ajastamine

Tehingud peaksid jõudma investeerimisühingute[26] asukoha pädevale asutusele hiljemalt tehingule järgneval tööpäeval kell 23.59.59 asukoha pädeva asutuse kohaliku aja järgi (st päeval T sooritatud tehingute aruanded tuleks esitada hiljemalt päeval T + 1 kell 23.59.59). Investeerimisühingud võivad esitada oma päeval T sooritatud tehingute üksikasjade aruanded ka samal päeval (päeval T), olenemata sellest, kas nad esitavad aruanded otse või esitab need nende nimel tegutsev tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja või kauplemiskoht, kelle süsteemi kaudu tehingud sooritati. See tähendab, et ühingud peavad esitama teabe kauplemiskohale või tunnustatud aruandlussüsteemile, et see saaks esitada aruande pädevale asutusele T + 1 tähtaja jooksul.

5.7.2.1.2 Tööpäev

Tööpäevad on kõik nädalapäevad, välja arvatud laupäev ja pühapäev ning tehinguaruande saajaks oleva riikliku pädeva asutuse liikmesriigi kõik riigipühad.

II osa. Plokid

5.8 1. plokk: ostja/müüja andmed

Pädevaid asutusi huvitab aluseks olev klient seoses turukuritarvitustega, mitte juriidilise isiku omanik. Seega, kui üleviimine põhjustab omandiõiguse muutuse, tuleks vastavalt esitada aruanne, kus ostjaks/müüjaks märgitakse klient, mitte valdajaks olla võiv hoidmisühing / esindajakonto omanik. Mujal kui edastamisel, mille korral on täidetud artiklis 4 sätestatud edastamistingimused ja mida käsitletakse punktis 5.26.3, peaksid investeerimisühingud siiski aruandesse märkima oma vahetu kliendi. Investeerimisühingutelt ei eeldata, et nad uuriksid kliendi või vastaspoole tausta ja püüaksid leida lõppkliendi. Näiteks kui investeerimisühingul puuduvad aluseks oleva kliendi andmed, ei pea ta leidma, kes on usaldusfondi tegelik klient, vaid esitama aruandes ostja/müüjana usaldusfondi (kes tuleks identifitseerida LEI abil). Kui aga investeerimisühingule on teada kliendi isik, kellele luuakse näiteks kogumispensioni usaldusfond, tuleks ostja/müüjana esitada klient, mitte usaldusfond.

[26] Või kauplemiskoha asukoha pädevale asutusele, kui kauplemiskohad esitavad aruandeid liikmete nimel, kes ei ole investeerimisühingud.

Allpool punktide 5.8.1–5.10.1 praktilistes näidetes kirjeldatakse ostjate identifitseerimist ja täiendavaid andmeid, kuid sama kehtib ka müüjate korral.

5.8.1 Ostja/müüja, kellele võidakse määrata LEI

See kehtib järgmistel juhtudel:

ostja/müüja on investeerimisühing, kes on turu vastaspool;

ostja/müüja on keskne vastaspool (kohaldatakse siis, kui tehing toimub kauplemiskohas anonüümses tellimusraamatus keskse vastaspoolega);

ostja/müüja on investeerimisühing, kes tegutseb kliendi korralduste süsteemse täitjana;

ostja/müüja on klient, kellele võidakse määrata LEI (vt I osa punkt 5.5 „Poolte tunnuskoodid“).

17. näide

Investeerimisühing X sooritab tehingu kliendi A nimel, kes ostab finantsinstrumendi.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	<Tx> <New> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)		
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)		
11	Ostja – sünniaeg		

5.8.2 Ostja/müüja on füüsiline isik

5.8.2.1 Ostja/müüja on EMP kodanik (ühe kodakondsusega)

Vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 6 tuleks aruandes füüsiline isik identifitseerida tunnusega, mis koosneb isiku kodakondsuse ISO 3166-1 alpha-2 (kahetäheline riigikood) kohasest koodist, millele järgneb isiku kodakondsusel põhinev sama määruse II lisas esitatud riiklik tunnus. Lisaks peaks vastavalt sama määruse artiklile 7, kui klient on füüsiline isik, esitama tehinguaruandes kliendi täisnime ja sünnikuupäeva.

18. näide

Investeerimisühing X sooritab tehingu kliendi 2 nimel, kes ostab finantsinstrumendi.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Jose Luis Rodriguez de la Torre {RIIKLIK_TUNNUS}	<Tx> <New> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ, DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> … </New> </Tx>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)	‘JOSE, LUIS’	
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)	‘RODRIGUEZ,DE LA TORRE’	
11	Ostja – sünniaeg	‘1976-02-27’	

Kasutatav tunnus määratakse isiku kodakondsuse, mitte elukoha ega investeerimisühingu X asukoha järgi.

Et investor on Hispaania kodanik, on tunnuseks maksukohustuslasena registreerimise number (*Código de identificación fiscal*), nagu on sätestatud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 II lisas. Skeemi nimi „NIDN“ tähendab, et kasutatakse riiklikku klienditunnust. Väärtus „CCPT“ tähendaks, et kasutatakse passinumbrit. Väärtus „CONCAT“ tähendab kodakondsusest, sünniajast ja nimelühendist moodustatud ühendtunnust. Järgmised kaks näidet illustreerivad kõigi kolme väärtuse kasutamist.

5.8.2.2 Ostja/müüja on EMP-välise riigi kodanik (ühe kodakondsusega)

19. näide

Investeerimisühing X müüb oma arvel kliendile finantsinstrumendi.
Klient on USA kodanik Paul O’Connor, kes elab Portugalis. Tema sünnikuupäev on 4. märts 1941.

Nagu on sätestatud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 II lisas, tuleks tehinguaruandes identifitseerida Paul O’Connor passinumbriga, sest tehinguaruandluse korral määrab kasutatava tunnuse kodakondsus, mitte isiku elukoht.

Paul O’Connori USA passi number on 123456789ZZ.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Paul O'Connori {RIIKLIK_TUNNUS}	<Tx> <New> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PAUL</FrstNm> <Nm>O'CONNOR</Nm> <BirthDt>1941-03-04</BirthDt> <Othr> <Id>US123456789ZZ</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> … </New> </Tx>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)	'PAUL'	
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)	'O'CONNOR'	
11	Ostja – sünniaeg	'1941-03-04'	

Kui Paul O'Connoril ei ole USA passi, tuleks väljale 7 märkida genereeritud ühendtunnus US19410304PAUL#OCONN.

5.8.2.3 Ostjal/müüjal on topeltkodakondsus (kaks EMP riiki)

20. näide

Investeerimisühing X sooritab kliendi jaoks tehingu.

Klient Anne-Marie Berg, kes finantsinstrumendi ostab, on Rootsi ja Prantsusmaa kodanik ning tema sünnikuupäev on 3. detsember 1963.

Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/590 artikli 6 lõike 3 nõuete kohaselt on Prantsusmaa ISO 3166 kahetäheline riigikood (FR) tähestikus eespool kui Rootsi kood (SE). Kasutada tuleb seega Prantsusmaa 1. prioriteedile vastavat tunnust, milleks on CONCAT-kood (komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 II lisa), mitte Rootsi isikukoodi. CONCAT-kood peaks olema FR19631203ANNEMBERG#.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Anne-Marie Bergi {RIIKLIK_TUNNUS}	<TxRpt> <Tx> <New> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)	'ANNE-MARIE'	
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)	'BERG'	

11	Ostja – sünniaeg	‘1963-12-03’	<Prsn> <FrstNm>ANNE-MARIE</FrstNm> <Nm>BERG</Nm> <BirthDt>1963-12-03</BirthDt> <Othr> <Id>FR19631203ANNEMBERG#</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> … </New> </Tx>

5.8.2.4 Ostjal/müüjal on topeltkodakondsus (EMP riik ja EMP-väline riik)

21. näide

Investeerimisühing X sooritab tehingu klient David Ştefani jaoks, kes ostab finantsinstrumendi. Kliendil on Austraalia ja Rumeenia kodakondsus ning tema sünnikuupäev on 8. mai 1952.

Vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 6 lõikele 3 on EMP kodakondsus prioriteetne, mistõttu tuleks kasutada Rumeenia riiklikku identifitseerimisnumbrit (*Cod Numeric Personal*).

David Ştefani Rumeenia riiklik identifitseerimisnumber on 1234567890123.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	David Ştefani {RIIKLIK_TUNNUS}	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>DAVID</FrstNm> <Nm>ŞTEFAN</Nm> <BirthDt>1952-05-08</BirthDt> <Othr> <Id>RO1234567890123</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)	‘DAVID’	
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)	‘ŞTEFAN’	
11	Ostja – sünniaeg	‘1952-05-08’	

			... </New> </Tx>

Selles näites tuleks siis, kui isikul puudub Rumeenia riiklik identifitseerimisnumber, kasutada Rumeenia passi numbrit. Kui isikul puudub pass, tuleks kasutada CONCAT-koodi, mis peaks olema RO19520508DAVIDSTEFA.

5.9 2. plokk: ostja/müüja otsustaja

Allpool praktilistes näitetes kirjeldatakse ostja otsustaja identifitseerimist, kuid sama kehtib ka müüja otsustaja korral.

Nagu on sätestatud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabelis 2, kasutatakse ostja otsustaja välju (väljad 12–15) üksnes juhul, kui ostjaks on klient ja investeerimisotsus tehakse esindusõiguse alusel. Esindusõigus seondub kolmanda isiku või isikutega, kes ei ole kliendiga seotud ja kellele on antud volitus teha investeerimisotsuseid kliendi nimel. Kolmas isik (kolmandad isikud) võivad olla sooritava investeerimisühinguga sidumata isikud või investeerimisühing ise. Esindusõiguse võib anda klient, kes on füüsiline või juriidiline isik, ning ka isikud, kellele on antud volitus tegutseda kliendi nimel, võivad olla füüsilised või juriidilised isikud.

Kui kolmas isik on investeerimisühing, tuleks väljale 12 märkida investeerimisühing, mitte investeerimisühingus tegutsev füüsilisest isikust otsustaja (kes esitatakse väljal 57).

See toimub järgmistel juhtudel:

kui esindusõigusega isik annab investeerimisühingule käsundi (sh volituse) või

kaalutlusõigusel põhineva volituse puhul, mille ostja on andnud sooritavale investeerimisühingule.

Kui ostja/müüja on andnud esindusõiguse mitmele isikule, tuleks otsustaja väljale märkida üksnes isik (isikud), kes andis (andsid) investeerimisühingule käsundi.

Kõigil muudel juhtudel eeldatakse, et otsustajaks on ostja, ning sellisel juhul otsustaja välju (väljad 12–15) ei täideta. See hõlmab ka olukorda, kus on antud volitus, kuid konkreetse tehingu suhtes on otsuse teinud ostja, mitte volitatud isik(ud).

Soovitused ja nõuanded ei ole investeerimisotsused, seega, kui on antud üksnes soovitus või nõuanne, tuleb otsustaja väljad jätta tühjaks.

Erandiks on fondid ja fondivalitsejatest ühingud, kelle korral peab fondivalitseja korraldust täitev investeerimisühing märkima fondivalitseja ostjaks/müüjaks ning jätma otsustaja väljad tühjaks, kui ei ole toimunud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 kohast edastamist (vt punkt 5.27.1).

5.9.1 Otsustajaks on ostja/müüja

22. näide

Investeerimisühing X sooritab tehingu kliendi A nimel, kes ostab finantsinstrumendi. Ostuotsuse teeb klient A.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja andmed?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA </LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... </New> </Tx>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)		
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)		
11	Ostja – sünniaeg		
12	Ostja otsustaja kood		
13	Ostja otsustaja – eesnimi (-nimed)		
14	Ostja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)		
15	Ostja otsustaja – sünniaeg		

Et investeerimisotsuse tegijaks on ostja, on otsustaja väljad tühjad.

5.9.2 Otsustajaks on ostja/müüja volitatud kolmas isik

5.9.2.1 Otsustajaks on volitatud isik

23. näide

Investeerimisühing X sooritab tehingu oma kliendi Sean Murphy jaoks, kes ostab finantsinstrumendi.

Sean Murphy on Iirimaa kodanik ja tema sünnikuupäev on 27. veebruar 1976. Murphy on andnud oma konto jaoks volikirja enda advokaadile Thomas MacCormackile, kes on Iirimaa kodanik, sünnikuupäev 12. detsember 1951. Ostukorralduse esitas MacCormack.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja andmed?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Sean Murphy {RIIKLIK_TUNNUS}	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>SEAN</FrstNm> <Nm>MURPY</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>IE19760227SEAN#MURPH</Id>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)	‘SEAN’	
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)	‘MURPHY’	
11	Ostja – sünniaeg	‘1976-02-27’	
12	Ostja otsustaja kood	Thomas MacCormacki {RIIKLIK_TUNNUS}	
13	Ostja otsustaja – eesnimi (-nimed)	‘THOMAS’	

14	Ostja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)	‘MACCORMACK’	<SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>THOMAS</FrstNm> <Nm>MACCORMACK</Nm> <BirthDt>1951-12-12</BirthDt> <Othr> <Id>IE19511212THOMAMACCO</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx>
15	Ostja otsustaja – sünniaeg	‘1951-12-12’	

Et Sean Murphy ja Thomas MacCormack on mõlemad Iirimaa kodanikud, kasutatakse tuletatud koodi, mis on Iirimaa 1. prioriteedile vastav tunnus. Koodid peaksid olema vastavalt IE19760227SEAN#MURPH ja IE19511212THOMAMACCO.

5.9.2.2 Otsustajaks on investeerimisühing, kes tegutseb ostja/müüja kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel

<u>24. näide</u>

Investeerimisühing X sooritab kliendi jaoks tehingu kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel. Seega teeb investeerimisühing X kliendi nimel investeerimisotsuse. Klient Pepe Torres Blanco on Mehhiko kodanik, passinumber MMM23654Z, sünnikuupäev 20. mai 1968.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja andmed?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Pepe Torres Blanco {RIIKLIK_TUNNUS}	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PEPE</FrstNm> <Nm>TORRES, BLANCO</Nm> <BirthDt>1968-05-20</BirthDt>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)	‘PEPE’	
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)	‘TORRES’, ‘BLANCO’	
11	Ostja – sünniaeg	‘1968-05-20’	
12	Ostja otsustaja kood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	

13	Ostja otsustaja – eesnimi (-nimed)		<Othr> <Id>MXMMM23654Z</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx>
14	Ostja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)		
15	Ostja otsustaja – sünniaeg		

5.10 3. plokk (1. ja 2. ploki kombinatsioon): Ostja/müüja ja otsustaja eristsenaariumid

Nagu ka eelmistes plokkides, kirjeldatakse järgmistes praktilistes näidetes ostjate identifitseerimist ja täiendavaid andmeid, kuid sama kehtib ka müüjate korral.

5.10.1 Ostja/müüja on ühiskonto

25. näide

Investeerimisühing X sooritab tehingu abikaasade Pierre DuPonti ja Marie DuPonti ühiskonto nimel. Pierre DuPont on Prantsusmaa kodanik, sünnikuupäev 27. veebruar 1976. Tema abikaasa Marie on Poola kodanik, sünnikuupäev 17. jaanuar 1977, riiklik identifitseerimisnumber (PESEL) 1234567890. Investeerimisotsuse teeb ühiskonto esindaja Charles Owen, kelle sünnikuupäev on 11. oktoober 1968. Ta on Lõuna-Aafrika kodanik (passinumber 1111222233334).

Ühiskonto ostab finantsinstrumendi.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes ostja teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Pierre DuPonti {RIIKLIK_TUNNUS} Marie DuPonti {RIIKLIK_TUNNUS}	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>PIERRE</FrstNm> <Nm>DUPONT</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>FR19760227PIERRDUPON</Id> <SchmeNm>
9	Ostja – eesnimi (-nimed)	‘PIERRE’ ‘MARIE’	
10	Ostja – perekonnanimi (-nimed)	‘DUPONT’ ‘DUPONT’	
11	Ostja – sünniaeg	‘1976-02-27’ ‘1977-01-17’	
12	Ostja otsustaja kood	Charles Oweni {RIIKLIK_TUNNUS}	

13	Ostja otsustaja – eesnimi (-nimed)	‘CHARLES’	<Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>MARIE</FrstNm> <Nm>DUPONT</Nm> <BirthDt>1977-01-17</BirthDt> <Othr> <Id>PL12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>CHARLES</FrstNm> <Nm>OWEN</Nm> <BirthDt>1968-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ZA1111222233334</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Buyr> ... </New> </Tx>
14	Ostja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)	‘OWEN’	
15	Ostja otsustaja – sünniaeg	‘1968-10-11’	

Välju 7–11 tuleb korrata iga ostja jaoks.

Otsustaja tegutseb ühiskonto, mitte kummagi füüsilise isiku nimel, mistõttu see väli täidetakse ainult üks kord.

5.10.2 Müüja on surnud

Tehingute puhul, mis sooritatakse seoses surnud klientide pärandiga, tuleks aruandes müüjaks märkida surnud isik ning otsustajaks loetakse surnud isik, mistõttu otsustaja välju ei ole vaja täita. Kui teine tehingupool on finantsinstrumentide pärija, tuleks ostjana esitada pärija ning otsustajaks loetakse pärija, mistõttu otsustaja välju ei ole tarvis täita.

5.11 4. plokk: ühingusisese investeerimisotsuse väli

5.11.1 Ühingusisese investeerimisotsuse väli

Nagu on sätestatud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 8 lõikes 1, tuleks see väli täita alati, kui investeerimisühing kaupleb oma arvel, sest ta riskib oma portfelliga ja seetõttu loetakse ta investeerimisotsuse tegijaks. Ainus erand on edastamisega seotud olukord, kus investeerimisühing esitab aruande vastuvõtva investeerimisühinguna ja kaupleb oma arvel, mis juhul peaks ta kooskõlas väljaga 57 märkima kliendipoole aruandesse edastavalt investeerimisühingult saadud teabe (vt punktid 5.26.3.1, 5.26.4.1, 5.26.4.2 ja 5.27.2).

Lisaks peab vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 8 lõikele 1 selle välja täitma ka siis, kui investeerimisühing teeb investeerimisotsuse kliendi eest, tegutsedes kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel (vt punkt 5.27.1).

26. näide

Investeerimisühing X ostab finantsinstrumendi.

Investeerimisotsuse eest vastutab investeerimisühingus peamiselt kaupleja 1.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama selle investeerimisotsuse ühingusisese investeerimisotsuse väljal?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
57	Ühingusisene investeerimisotsus	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	<Tx> <New> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> ... </New> </Tx>

Seejuures ei nõuta erinevalt ostja andmetest investeerimisühingus investeerimisotsuse eest vastutava konkreetse füüsilise isiku andmeid. Andmetest nõutakse üksnes füüsilise isiku riiklikku tunnust.

Kui investeerimisotsuse eest vastutas peamiselt investeerimisühingu algoritm, märgitakse väljale 57 algoritmi kood.

5.11.2 Väljaspool ühingut tehtud investeerimisotsus (investeerimisotsuse teeb klient ning investeerimisühing tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel või „muu volituse alusel“)

27. näide

Investeerimisühing X tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel või „muu volituse alusel“ ning ostab finantsinstrumendi kliendile, kelle jaoks ta on üksnes sooritaja või nõustaja.

Investeerimisotsus loetakse tehtuks kliendi poolt olenemata sellest, kas investeerimisühing X on finantsinstrumenti kliendile soovitanud, sest lõpliku investeerimisotsuse on teinud klient.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama selle investeerimisotsuse ühingusisese investeerimisotsuse väljal?

Et investeerimisühing X tegutseb „muu volituse alusel“ või kliendikorralduste sobitamise teel, jäetakse väljad 57 ja 12 täitmata.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
57	Ühingusisene investeerimisotsus		<Tx> <New> … <FinInstrm> … </FinInstrm> <ExctgPrsn> … </ExctgPrsn> … </New> </Tx> *Kui väli on täitmata, ei peaks sõnum vastavat XML-elementi (<InvstmtDcsnPrsn>) sisaldama*

Kui aga investeerimisühing X kaupleb oma arvel, isegi kui tehing on kliendi algatatud, loetakse investeerimisotsuse tegijaks investeerimisühing X, mistõttu tuleks täita väli 57, kuid väli 12 peaks olema tühi.

5.12 5. plokk: ühingusisese täitmise väli

Väli 59 täidetakse igas tehinguaruandes. Kui täitmisotsuse tegi klient (klient andis käsundi tehingu andmetega, sh täitmiskohaga) või muu isik väljaspool investeerimisühingut (sama kontserni äriühingu töötaja), peaksid investeerimisühingud sellel väljal kasutama vaikeväärtust ‘NORE’.

28. näide

Investeerimisühing X ostab kliendi jaoks finantsinstrumendi, kusjuures klient andis tehingu konkreetsete üksikasjadega käsundi.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama selle aruandes ühingusisese täitmise väljal?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
59	Ühingusisene täitmine	'NORE'	<Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

Kui väljale märgitakse muu kood kui 'NORE', peab see kood – vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 9 sätestatule – olema investeerimisühingu sisese isiku või algoritmi tunnus, olenevalt sellest, kes täitmise eest peamiselt vastutas. Investeerimisühing on kohustatud määrama selle vastavalt oma sise-eeskirjadele.

5.12.1 Täitmise eest vastutas peamiselt füüsiline isik

Kui täitmise eest vastutas peamiselt füüsiline isik, märgitakse väljale 59 tema riiklik tunnus.

5.12.2 Täitmise eest vastutas peamiselt algoritm

29. näide

Kui täitjaks oli algoritm, tuleks I lisa tabeli 2 väljale 59 märkida algoritm.

Investeerimisühing X ostab finantsinstrumendi ning tehingu täitmise eest vastutas investeerimisühingu X algoritm (kood 4567EFZ).

Kuidas peab investeerimisühing X esitama selle aruandes ühingusisese täitmise väljal?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
59	Ühingusisene täitmine	{Algoritmi kood}	<Tx> <New> ... <ExctgPrsn> <Algo>4567EFZ</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

Mõiste „algoritm" tähendab kõiki süsteeme, mis sooritavad automaatselt tehinguid inimese sekkumiseta. Sel juhul tuleks aruandesse märkida ka automaatsüsteemi tunnus.

5.13 6. plokk: kauplemise kuupäev ja aeg

Aruandesse märgitav kauplemise kuupäev ja kellaaeg peaks olema aeg, mil tehing toimub ja pooled tehinguga nõustuvad, mitte võimaliku hilisema kinnitamise kuupäev ja kellaaeg.

Kui investeerimisühing saadab tellimuse täitmiseks EMP-välisele ühingule, peaks investeerimisühing tegema kõik võimaliku, et saada täpseim kuupäev ja kellaaeg.

Väljal 28 (kauplemise kuupäev ja aeg) ei peaks väärtusi ümardama ning ajaline detailsus peaks vastama komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 tabelis 2 olevatele välja 28 nõuetele.

Tehinguaruannete ajalise detailsuse nõuete üksikasjalik teave: vt punkt 7.2 (ajatempli detailsus).

5.14 7. plokk: koht

Selle ploki näidetes selgitatakse koha välja ja muude asjakohaste väljade täitmist otsese turutehingu korral. Nagu selgitatakse punktis 5.4.2 „Koha välja täitmine ahelate korral“, tuleks kohaks märkida üksnes vahetu sooritamise kauplemiskoht[27] või -platvorm või kliendi korralduste süsteemne täitja. Koha välja täitmise näited muude stsenaariumide korral on punktides 5.22–5.24 ja 5.26–5.27 (mitme tehinguga täitmise, korralduste grupeerimise, kliendikorralduste sobitamise teel tegutseva organiseeritud kauplemissüsteemi ja investeerimisühingute ahela kaudu täitmise ning kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel tegutseva investeerimisühingu stsenaariumid).

Konkreetsete finantsinstrumentidega tehtavate tehingute aruandluse üksikasjad on IV osas.

5.14.1 Tehingu sooritamine kauplemiskohas anonüümses tellimusraamatus

30. näide

Investeerimisühing X müüb kauplemiskohas finantsinstrumendi. Tehing sooritati 5. mail 2018 kell 09.10.33,124373. Kauplemiskoht genereerib kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi (TVTIC) (ABCDEFG123456).

a) Kauplemiskoht M (kes kasutab keskset vastaspoolt)

b) Kauplemiskoht B ei kasuta keskset vastaspoolt ja omandava/võõrandava poole isikut sooritamise hetkel ei avaldatud. Tema segmendi MIC on ‘XABC’.

Kuidas peaks investeerimisühing X täitma aruandes koha välja ja seonduvad väljad?

Nr	Andmeväli	Väärtused (stsenaarium a)	Väärtused (stsenaarium b)
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘ABCDEFG123456’	‘ABCDEFG123456’
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Kauplemiskoha B segmendi {MIC}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-05-05T09:10:33.124Z’	‘2018-05-05T09:10:33.124Z’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha B segmendi {MIC}

XML:

Aruanne (stsenaarium a)	Aruanne (stsenaarium b)

[27] See hõlmab juhtumeid, kus väljaspool kauplemiskohta kokku lepitud tehingud tehakse vastava kauplemiskoha eeskirjade alusel.

<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>ABCDEFG123456</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <MIC>XABC</MIC> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Tx> <TradDt>2018-05-05T09:10:33.124Z</TradDt> … <TradVn>XABC</TradVn> <TradPlcMtchgId>ABCDEFG123456</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx>

5.14.2 Tehingu sooritamine Euroopa Liidu välisel kauplemisplatvormil mitteanonüümses tellimusraamatus

31. näide

Investeerimisühing X müüb aruandluskohustuse alla kuuluva finantsinstrumendi liiduvälisel organiseeritud kauplemisplatvormil (MIC: XAAA), täites investeerimisühingu Y ostukorralduse. Tehing sooritati 10. septembril 2018 kell 13.15.45,122469.

Kuidas peaks investeerimisühing X täitma aruandes koha välja ja seonduvad väljad?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood		<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr>
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-10T13:15:45Z’	
36	Koht	Kauplemis-platvormi segmendi {MIC}	

			... <Tx> <TradDt>2018-09-10T13:15:45Z</TradDt> … <TradVn>XAAA</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

Praegusel juhul kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi ei kasutata, sest tehingut ei sooritata kauplemiskohas.

Investeerimisühing X teab turu vastaspoolt (investeerimisühing Y), mistõttu turu vastaspool märgitakse tehinguaruandesse, praegusel juhul ostjana.

Et tehing ei toimu kauplemiskohas, peaks aruandesse märgitava aja detailsus olema sekundites või täpsem.

5.14.3 Tehingu sooritamine kauplemiskohas oma korralduse täitmisega anonüümses tellimusraamatus

Nagu on märgitud I osa punktis 5.6 „Tehingu mõiste“, on see olukord, millele tuleks kohaldada artikli 2 lõiget 4.

32. näide

Oma arvel tegutsev investeerimisühing X täidab kauplemiskohas M oma korralduse ning genereeritakse kauplemiskoha tehingu tunnuskood (TVTIC) (ABCDEFG123456) nimetatud tehingule, mis sooritatakse 15. juulil 2018 kell 11.37.22,867415.

Kuidas peaks investeerimisühing X täitma aruandes koha välja ja seonduvad väljad?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘ABCDEFG123456’	‘ABCDEFG123456’
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-15T11:37:22.867Z’	‘2018-07-15T11:37:22.867Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}

XML:

1. aruanne	2. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.867Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <TradVn>XABC</TradVn> … <TradPlcMtchgId>ABCDEFG123456</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.867Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <TradVn>XABC</TradVn> … <TradPlcMtchgId>ABCDEFG123456</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx>

5.14.4 Tehingu sooritab kliendi korralduste süsteemne täitja

33. näide

Investeerimisühing Y soovib müüa aktsiaid. Kliendi korralduste süsteemse täitjana tegutsev investeerimisühing X ostab investeerimisühingult Y nimetatud aktsiad. Tehing sooritati 15. juulil 2018 kell 11.37.22.Z.

Süsteemse täitja segmendi MIC on SMIC

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood		

4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-15T11:37:22.Z’	‘2018-07-15T11:37:22.Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’
36	Koht	Kliendi korralduste süsteemse täitja (investeerimisühing X) segmendi {MIC}	Kliendi korralduste süsteemse täitja (investeerimisühing X) segmendi {MIC}

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-15T11:37:22.Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>SMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

5.15 8. plokk: lühikeseks müügi indikaator

Järgmised praktilised näited kirjeldavad olukordi, kus investeerimisühing müüb oma arvel või kliendi nimel lühikeseks[28] aruandluskohustuse alla kuuluvaid aktsiaid või riigi võlakohustusi vastavalt määruse (EL) nr 236/2012 artiklitele 12, 13 ja 17.Investeerimisühing peaks paluma kliendil avaldada, kas ta müüb lühikeseks või mitte.

Kui klient ei ole investeerimisühingule lühikeseks müügi kohta teavet andnud, tuleks väljale 62 märkida 'UNDI'.

Lühikeseks müügi indikaatorit kasutatakse aruannetes, mis kajastavad tehinguid üksikklientidega, mitte turutehingute koondaruandes. Seega kui mõlemad kliendid müüvad või üks klient müüb lühikeseks, tuleks lühikeseks müügi indikaator turutehingute koondaruandes tühjaks jätta, sest aruanne ei käsitle konkreetset klienti, vaid kõiki kliente, kelle korraldused on koondatud.

Näited juhtumite kohta, kus toimub koondamine ning kasutatakse lühikeseks müügi indikaatorit, on punktides 5.23, 5.24 ja 5.27.2.

5.15.1 Investeerimisühingu X klient müüb lühikeseks (ühingul X on vastav teave)

34. näide

Investeerimisühing X müüb aktsiaid kliendi A nimel. Klient A müüb lühikeseks.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes lühikeseks müügi teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
16	Müüja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
18	Müüja – eesnimi (-nimed)		
19	Müüja – perekonnanimi (-nimed)		
20	Müüja – sünniaeg		
62	Lühikeseks müügi indikaator	'SESH'	

[28] Vastavalt määruse (EL) nr 236/2012 artikli 2 lõike 1 punkti b määratlusele.

5.15.2 Investeerimisühing X müüb lühikeseks enda nimel

35. näide

Investeerimisühing X müüb riigi võlakohustust enda nimel.

5.15.2.1 Tehing toimub erandi alusel

Tehing toimub turutegemise või esmasturu erandi alusel, mis on sätestatud määruse (EL) nr 236/2012 artiklis 17.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes lühikeseks müügi teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> .... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SSEX</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> ... </New> </Tx>
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	
62	Lühikeseks müügi indikaator	‘SSEX’	

5.15.2.2 Tehing ei toimu erandi alusel

Tehing ei toimu turutegemise või esmasturu erandi alusel, mis on sätestatud määruse (EL) nr 236/2012 artiklis 17.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes lühikeseks müügi teabe?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New>

16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
62	Lühikeseks müügi indikaator	‘SESH’	

5.16 9. plokk: vabastuse, börsivälise kauplemise järgse etapi ja kaubatuletisinstrumendi indikaatorid

5.16.1 Vabastuse indikaator ja börsivälise kauplemise järgse etapi indikaator

Välja 61 peaks täitma investeerimisühing, kes esitas kauplemiskohale korralduse või esitas kauplemiskohale kauplemise kohta aruande.

Investeerimisühing ei peaks märkima väljale 63 börsivälise kauplemise järgse etapi indikaatorit ‘CANC’, sest artikli 26 lõikes 3 sätestatud kohustus kasutada börsivälise kauplemise järgse etapi indikaatoreid eeldab MiFIRi artikli 26 kohase tehingu olemasolu komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 tähenduses ning tühistamist ei loeta MiFIRi artikli 26 järgi tehinguks.

5.16.1.1 Kauplemiskohas sooritatud tehing

<u>36. näide</u>

Investeerimisühing X sooritab kliendi jaoks tehingu, kaubeldes oma arvel. Instrumendiks on aktsia. Investeerimisühing X ostab finantsinstrumendi kauplemiskohas M ja seejärel müüb selle kliendile.

Ost kauplemiskohas sooritatakse MiFIRi artikli 4 kohase „võrdlushinnaga tehingu“ vabastuse alusel. Müük kliendile on MiFIRi artikli 20 lõike 3 punkti a kohane „suuremahuline tehing“.

Et tehingu turupool sooritati kauplemiskohas, peaks investeerimisühing X aruandes täitma vabastuse indikaatori välja. Investeerimisühing X peaks aruandesse märkima ka börsivälise kauplemise järgse etapi indikaatori seoses tehingu kliendipoolega.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes vabastuse indikaatori ja börsivälise kauplemise järgse etapi indikaatori?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’
61	Vabastuse indikaator	‘RFPT’	
63	Börsivälise kauplemise järgse etapi indikaator		‘LRGS’

XML:

1. aruanne (turupoole aruanne)	2. aruanne (kliendipoole aruanne)
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <WvrInd>RFPT</WvrInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

5.16.1.2 Börsiväliselt sooritatud tehing

37. näide

Investeerimisühing X sooritab investeerimisühinguga Y börsivälise aktsiatehingu. Investeerimisühingud X ja Y kauplevad mõlemad oma arvel. Mahu tõttu on tehing suuremahuline tehing.

Et tehing sooritatakse börsiväliselt, on kohaldatav üksnes börsivälise kauplemise järgse etapi indikaator.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’
61	Vabastuse indikaator		

63	Börsivälise kauplemise järgse etapi indikaator	‘LRGS’	‘LRGS’

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <TradVn>XOFF</TradVn> … </Tx> ... <AddtlAttrbts> … <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> ... <OTCPstTradInd>LRGS</OTCPstTradInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

5.16.1.3 Väljaspool tellimusraamatut, ent kauplemiskoha eeskirjade alusel sooritatud tehing

38. näide

Investeerimisühing X sooritab kliendi nimel tehingu, ostes kapitaliinstrumendi ühingult Y. Tehing toimub väljaspool tellimusraamatut, ent kauplemiskoha M eeskirjade alusel. Tehing sooritatakse vabastuse „määratud vastaspoolega tehingud mittelikviidsete finantsinstrumentidega“ alusel vastavalt MiFIRi artikli 4 lõike 1 punkti b alapunktile ii.

Investeerimisühing Y on kauplemiskoha liige ning esitas kauplemisaruande kauplemiskohale, kes seejärel esitas tehingu kohta kauplemisjärgse läbipaistvusteate.

Investeerimisühing Y ja klient A tegutsevad oma arvel.

Investeerimisühing Y peaks märkima tehinguaruandesse vabastuse indikaatori, sest ta esitas kauplemiskohale kauplemisaruande, ning vabastuse indikaatori võib märkida ka investeerimisühing X, kui tal on vastav teave.

Et X ja Y vaheline tehing toimus kauplemiskoha eeskirjade alusel, ei märgi nad oma aruannetesse börsivälise kauplemise järgse etapi indikaatorit, sest seda kohaldatakse üksnes kauplemiskohas sooritatud tehingutele.

Klient A ei peaks vabastuse indikaatorit märkima, sest ta ei esita aruannet kauplemiskohas toimunud tehingu turupoole kohta. Klient A ei peaks mingil juhul märkima börsivälise kauplemise järgse etapi indikaatorit, sest see ei ole eraldi börsiväline tehing, vaid turul sooritatud tehinguga seotud klienditoiming, st ahela osa.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y ning kliendi A aruannetes, kui klient A on investeerimisühing?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes	Väärtused kliendi A aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}	Kliendi A {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
29	Kauplemisvolitused	'AOTC'	'DEAL'	'DEAL'
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	'XOFF'
61	Vabastuse indikaator		'OILQ'	
63	Börsiväline kauplemisjärgne indikaator			

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne	Kliendi A aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> … </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> … </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</ExctgPty> ... <Tx> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> … </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts> <WvrInd>OILQ</WvrInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>

5.16.2 Kauplemisjärgne indikaator juhul, kui investeerimisühing viib börsiväliselt kokku kaks kliendikorraldust

Vt punkt 5.20.

5.16.3 Kaubatuletisinstrumendi indikaator

5.16.3.1 Kui klient on teatanud, et vähendab oma riski

39. näide

Investeerimisühing X on sooritanud kliendi 3 nimel, kes ei ole finantsinstitutsioon, tehingu MiFIRi artikli 2 lõike 1 punktis 30 sätestatud kaubatuletisinstrumendiga, kusjuures klient 3 on teatanud, et vähendab oma riski objektiivselt mõõdetaval viisil vastavalt direktiivi 2014/65/EL artiklile 57. Investeerimisühing X tegutseb „muu volituse alusel“.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes kauba tuletisinstrumendi indikaatori?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	XML
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	<Tx> <New> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... </Tx> ... <AddtlAttrbts>
64	Kaubatuletisinstrumendi indikaator	‘true’	

			<RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Kui klient 3 ei ole investeerimisühingule X teatanud, et vähendab oma riski objektiivselt mõõdetaval viisil vastavalt direktiivi 2014/65/EL artiklile 57, peaks investeerimisühing X märkima väljale 64 ‘false’.

5.16.3.2 Kui instrument ei ole kaubatuletisinstrument

40. näide

Investeerimisühing X on sooritanud kliendi 3 nimel tehingu instrumendiga, mis ei ole määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punktis 30 määratletud kaubatuletisinstrument.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes kauba tuletisinstrumendi indikaatori?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	XML
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	<Tx> <New> ... <Tx> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> </Tx> ... </New> </Tx>
64	Kaubatuletisinstrumendi indikaator		

Et instrument ei ole MiFIRi artikli 2 lõike 1 punktis 30 määratletud kaubatuletisinstrument, ei kohaldata välja 64 ja seda ei tuleks täita.

5.17 10. plokk: filiaalid

5.17.1 Kliendi nimel sooritatud tehing

41. näide

Hollandi investeerimisühingu D LEI on 13579135790246802468. Ühingul on filiaalid Pariisis (FR), Londonis (GB) ja Frankfurdis (DE). Investeerimisühing saab Hispaania kliendilt E oma kaupleja 7 kaudu korralduse osta teatud finantsinstrumenti. Kliendi E LEI on 24242424242424242424. Klient saadab korralduse Pariisi filiaalile. Pariisi filiaal edastab korralduse Londoni kauplemisüksusele. Londoni filiaali järelevalve all tegutsev kaupleja 8 otsustab täita korralduse kauplemiskohas M. Kaupleja 7 on Prantsusmaa kodanik Jean Bernard, sünnikuupäev 4. mai 1972. Kaupleja 8 on Ühendkuningriigi

kodanik, kelle Ühendkuningriigi sotsiaalkindlustusnumber on QQ123456C. Kauplemiskoha M liikmeks on Frankfurdi filiaal.[29]

Tehinguaruanne esitatakse AFM-ile (NL).

Kuidas peavad investeerimisühing D ja klient E täitma aruandes filiaali väljad, kui kliendil E on tehinguaruandluse kohustus ning ta kaupleb oma arvel?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu D aruandes	Väärtused kliendi E aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Ühingu D {LEI}	Kliendi E {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kliendi E {LEI}	Kliendi E {LEI}
8	Ostjat esindava filiaali riik	‘FR’	
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Ühingu D {LEI}
17	Müüjat esindava filiaali riik		
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘DEAL’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’
37	Filiaali liikmesusejärgne riik	‘DE’	
57	Ühingusisene investeerimisotsus		Kaupleja 7 {RIIKLIK_TUNNUS}
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik		‘ES’
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 8 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 7 {RIIKLIK_TUNNUS}
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	‘GB’	‘ES’

XML:

Investeerimisühingu D aruanne	Kliendi E aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>13579135790246802468</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>24242424242424242424</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>24242424242424242424</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>24242424242424242424</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>13579135790246802468</LEI> </Id>

[29] Mõnes õigussüsteemis on võimalik ja vahel ka tavaline, et turu liikmed on (kohalikud) filiaalid.

```
    </Sellr>
    ...
    <Tx>
     ...
     <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
     ...
     <TradVn>XMIC</TradVn>
     <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch>
    </Tx>
    ...
    <ExctgPrsn>
     <Prsn>
      <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch>
      <Othr>
       <Id>QQ123456C </Id>
       <SchmeNm>
        <Cd>NIDN</Cd>
       </SchmeNm>
      </Othr>
     </Prsn>
    </ExctgPrsn>
    ...
  </New>
  </Tx>
```

```
    </AcctOwnr>
   </Sellr>
   ...
   <Tx>
    …
    <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
    ...
    <TradVn>XOFF</TradVn>
   </Tx>
   ...
   <InvstmtDcsnPrsn>
    <Prsn>
     <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch>
     <Othr>
      <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id>
      <SchmeNm>
       <Prtry>CONCAT</Prtry>
      </SchmeNm>
     </Othr>
    </Prsn>
   </InvstmtDcsnPrsn>
   <ExctgPrsn>
    <Prsn>
     <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch>
     <Othr>
      <Id>FR19720504JEAN#BERNA</Id>
      <SchmeNm>
       <Prtry>CONCAT</Prtry>
      </SchmeNm>
     </Othr>
    </Prsn>
   </ExctgPrsn>
   …
  </New>
 </Tx>
```

Investeerimisühing D ega klient E ei täida välja 17, sest see väli täidetakse üksnes siis, kui müüja väljale on märgitud sooritava investeerimisühingu klient. Samuti ei täideta kliendi E tehinguaruandes välja 8, sest klient E ei ole väljale 7 märkinud aluseks olevat klienti.

Investeerimisühingu D aruandes on väli 57 tühi, sest investeerimisühing D tegutseb „muu volituse alusel“. Investeerimisühingu D aruandes ei ole vaja täita välja 58, sest väli 57 on tühi.

Klient märgib väljale 58 kliendi E peakontori riigi koodi (ES), sest tehing ei hõlmanud filiaale.

5.17.2 Oma arvel sooritatud tehing

42. näide

Kaupleja 7, kes kuulub Hispaania investeerimisühingu E peakontori järelevalve alla, LEI 12312312312312312312, millel on filiaalid Pariisis (FR), Londonis (GB) ja Frankfurdis (DE), otsustab müüa teatud finantsinstrumendi. Kaupleja 7 otsustab täita korralduse kauplemiskohas M. Kauplemiskoha M liikmeks on Frankfurdi filiaal.

Tehinguaruanne esitatakse CNMV-le (ES).

Kuidas peab investeerimisühing E täitma aruandes filiaali väljad?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu E {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12312312312312312312</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12312312312312312312</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> ... </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19720504JEAN#BERNA </Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ...
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	
8	Ostjat esindava filiaali riik		
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu E {LEI}	
17	Müüjat esindava filiaali riik		
29	Kauplemis-volitused	‘DEAL’	
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	
37	Filiaali liikmesusejärgne riik	‘DE’	
57	Ühingusisene investeerimis-otsus	Kaupleja 7 {RIIKLIK_TUNNUS}	
58	Investeerimis-otsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik	‘ES’	
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 7 {RIIKLIK_TUNNUS}	
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	‘ES’	

			</New> </Tx>

Väli 17 on tühi, sest see väli täidetakse üksnes siis, kui müüjaks märgitakse klient.

5.17.3 EMP-väliste ühingute EMP filiaalide sooritatud tehingud

43. näide

Kaupleja, kelle üle teeb järelevalvet Ameerika ühingu F peakontor, LEI 22222222222222222222, millel on filiaalid Pariisis (FR), Londonis (GB) ja Frankfurdis (DE), otsustab osta teatud finantsinstrumendi. Kaupleja sooritab tehingu kauplemiskohas M. Kauplemiskoha M liikmeks on Frankfurdi filiaal. Ühing kaupleb oma arvel.

Kuidas peab ühing F täitma aruandes filiaali väljad?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Ühingu F {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>22222222222222222222</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>22222222222222222222</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> … </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn>
7	Ostja tunnuskood	Ühingu F {LEI}	
8	Ostjat esindava filiaali riik		
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	
17	Müüjat esindava filiaali riik		
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	
37	Filiaali liikmesusejärgne riik	‘DE’	
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik	‘US’	
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	‘US’	

			<CtryOfBrnch>US</CtryOfBrnch> … </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

Väljad 8 ja 17 (müüja ja ostja filiaali riik) on tühjad, sest need täidetakse üksnes siis, kui ostjaks või müüjaks märgitakse kliendid.

Tehinguaruandluseks tuleb eelnevalt otsustada, mis pädevale asutusele tehinguaruanne esitatakse. Pädev asutus ei pea olema tehingus osalenud filiaalidele tegevusloa väljastanud pädev asutus, vaid üks pädevatest asutustest, kes on andnud ühingu filiaalile tegevusloa vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 14 kohasele kolmanda riigi ühingu ühisele valikule. Ülal näites võib tehinguaruande esitada Ühendkuningriigi, Prantsusmaa või Saksamaa pädevatele asutustele.

Nagu on sätestatud komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/590, kui EMP-välise ühingu EMP filiaal sooritab artiklis 3 sätestatud toimingu, on see filiaal sooritaja ja peab esitama tehinguaruande. Praegusel juhul on sooritaja Saksamaa filiaal, sest see kaupleb turul, seega tuleb ühingu F tehinguaruanne täita eespool kirjeldatud viisil.

5.18 11. plokk: tehinguaruannete olek ja parandused

Tehingu puhul, mille kohta ei ole veel esitatud aruannet, ja ebatäpse tehinguaruande parandamiseks pärast algse tehinguaruande tühistamist tuleb väljale 1 märkida olek ‘NEWT’.

Tehinguaruannete tühistamiseks aruandekohustuse alla mittekuuluvate tehingute korral ja vigu sisaldavate tehinguaruannete tühistamiseks enne uue tehinguaruande esitamist märgitakse olekuks ‘CANC’.

Tehingute viitenumbrid peaksid sooritaval investeerimisühingul olema igas tehinguaruandes kordumatud. Kui seotud on mitu tunnustatud aruandlussüsteemi pakkujat, tuleks tehingu viitenumber alati genereerida sooritava investeerimisühingu tasandil. Tehingu viitenumbrit ei tohiks taaskasutada, v.a algse tehinguaruande parandamise või tühistamise korral, mis juhul tuleks uues tehinguaruandes kasutada sama tehingu viitenumbrit kui asendatavas algses aruandes (vt punktid 5.18.3 ja 5.18.4). Tehingu viitenumbrit tuleks taaskasutada sama tehinguaruande kõigi hilisemate paranduste korral. Võib juhtuda, et sama tehinguga on seotud mitu kirjet (uut või tühistamiskirjet), mis tuleks esitada samas failis (sama tehingu viitenumbri ja sooritava isiku tunnuskoodiga). Sel juhul peab kirjete järjekord failis järgima kirjete töötlemise loogikat, st i) tühistada saab üksnes tehingu, mille kohta on esitatud uue tehingu aruanne ja mida ei ole veel tühistatud, ning ii) sama tunnusega (sama tehingu viitenumbri ja sooritava isiku tunnuskoodiga) tehingu saab esitada üksnes siis, kui selle tehingu eelmine aruanne on tühistatud. Eelkõige tuleks arvestada järgmisi olukordi:

a) uue tehingu aruanne esitatakse ja kohe ka tühistatakse (mõlemad aruanded esitatakse samas failis) → uue tehingu aruanne peaks failis olema tühistamisaruandest eespool;

b) mõnes varasemas failis esitatud tehing tühistatakse ja samal ajal esitatakse tehingu uus versioon (eelmine aruanne tühistatakse ja uus versioon esitatakse samas failis) → eelmise tehinguaruande tühistamine peaks failis olema eespool kui uus tehinguaruanne (tehingu uus versioon);

c) eespool kirjeldatud olukordade kombinatsioon (st ühe tehinguga on seotud mitu uut või tühistamiskirjet) → olenevalt olukorrast (a või b) peaks esimene kirje failis olema uus kirje või eelmiste kirjete tühistamiskirje ning järgmised kirjed peaksid olema järjestatud nii, et igale kirjele järgneb vastupidine kirje.

5.18.1 Tühistamised ja muudatused samal päeval

Kui investeerimisühing esitab kauplemisjärgse teate ja tühistab selle kauplemisjärgse teate enne tehinguaruande esitamist, ei pea esitama tehinguaruannet.

Kui investeerimisühing esitab kauplemisjärgse teate ja muudab seda enne tehinguaruande esitamist, tuleb tehinguaruandes kajastada üksnes viimases kauplemisjärgses teates sisalduvat teavet.

5.18.2 Uue tehinguaruande esitamine

44. näide

Investeerimisühing X sooritab börsivälise tehingu 10. märtsil 2018 kell 12.45.30. Tehinguaruanne esitatakse tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja 1 kaudu (kelle LEI on ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1). Tehingu viitenumber on ETYRU9753.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused algses aruandes	XML
1	Aruande staatus	‘NEWT’	<Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> ... <Tx> <TradDt>2018-03-10T12:45:30Z</TradDt> </Tx> ... </New> </Tx> *NB! Sõnumis puudub välja 1 XML-element. Selle asemel kasutatakse silti New või Cxl.*
2	Tehingu viitenumber	‘ETYRU9753’	
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
6	Esitava isiku tunnuskood	Tunnustatud aruandlus-süsteemi pakkuja 1 {LEI}	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-03-10T12:45:30Z’	

5.18.3 Tühistamine

45. näide

Investeerimisühing X esitab uue tehinguaruande (punktis 5.18.2 kirjeldatud andmetega) tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja 1 kaudu (kelle LEI on ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1) ning seejärel tühistab tehinguaruande.

Seejuures võib tühistajaks olla ka muu esitav isik kui aruande algne esitaja. Näiteks võib investeerimisühing kasutada algse aruande esitamiseks üht tunnustatud aruandlussüsteemi pakkujat ja aruande ise tühistada või kasutada teist tunnustatud aruandlussüsteemi pakkujat.

Tühistamiste korral tuleks täita üksnes põhiväljad 1, 2, 4 ja 6. Ühingud ei saa kogu aruannet uuesti esitada. Kui tehinguaruanne esitatakse uuesti ja selles on lisaks põhiväljadele täidetud veel välju, lükatakse see tagasi.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused algses aruandes	Väärtused tühistamisaruandes
1	Aruande staatus	'NEWT'	'CANC'
2	Tehingu viitenumber	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
6	Esitava isiku tunnuskood	Tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja 1 {LEI}	Tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja 1 {LEI}

XML:

Algne aruanne	Tühistamisaruanne
<Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> … </New> </Tx> *NB! Sõnumis puudub välja 1 XML-element. Selle asemel kasutatakse silti New või Cxl.*	<Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </Cxl> </Tx> *NB! Sõnumis puudub välja 1 XML-element. Selle asemel kasutatakse silti New või Cxl.*

5.18.4 Tehinguaruandes sisalduva teabe parandamine

Tehinguaruandes sisalduva teabe osaliseks parandamiseks tuleb algne aruanne tühistada ja esitada uus aruanne.

Tühistamiste korral tuleks täita üksnes põhiväljad 1, 2, 4 ja 6. Tehinguaruande tühistamise aruanne, mis sisaldab lisaks neile neljale väljale veel välju, lükatakse tagasi.

Uus aruanne peaks sisaldama kõiki aruande esemeks oleva tehingu puhul kohaldatavaid välju.

46. näide

Investeerimisühing X sooritas punktis 5.18.2 nimetatud tehingu hinnaga 5 GBP, kuid esitas tehinguaruande väikestes, mitte suurtes valuutaühikutes (pennides, mitte naelsterlingites).

Tehinguaruanne tühistatakse järgmisel päeval kell 14.50.20 ning samal ajal esitatakse uus aruanne, milles hind on parandatud.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused algses aruandes	Väärtused tühistamisaruandes	Väärtused uues aruandes
1	Aruande staatus	'NEWT'	'CANC'	'NEWT'
2	Tehingu viitenumber	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'	'ETYRU9753'
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
6	Esitava isiku tunnuskood	Tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja 1 {LEI}	Tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja 1 {LEI}	Tunnustatud aruandlussüsteemi pakkuja 1 {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	'2018-03-10T12:45:30Z'		'2018-03-10T12:45:30Z'
33	Hind	'500'		'5'

XML:

Algne aruanne	Tühistamisaruanne	Uus aruanne
<Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> ... <Tx> <TradDt>2018-03-10T12:45:30Z</TradDt> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">500</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... </Tx> ... </New>	<Tx> <Cxl> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> </Cxl> </Tx>	<Tx> <New> <TxId>ETYRU9753</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <SubmitgPty>ARM1ARM1ARM1ARM1ARM1</SubmitgPty> ... <Tx> <TradDt>2018-03-10T12:45:30Z</TradDt> … <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... </Tx>

</Tx>		... </New> </Tx>

Seejuures peavad kuupäev ja kellaaeg olema algse tehingu omad, st '2018-03-10T12:45:30Z', mitte parandusaruande kuupäev ja kellaaeg. Samuti tuleb arvestada, nagu läbivalt käesolevates suunistes, et algne ja uus aruanne peavad sisaldama kõiki tehingu andmeid ning ülal näidetes on üksnes aruannete väljavõtted.

5.19 12. plokk: tingliku väärtuse muutus

5.19.1 Tingliku väärtuse suurenemine

47. näide

Investeerimisühing X müüb investeerimisühingule Y 26. oktoobril 2018 kell 08.21.01 2 miljoni euro eest krediidiriski vahetustehingu kaitse. Krediidiriski vahetustehingu fikseeritud kupongimäär on 100 bps ning investeerimisühing X saab ettemakse 50 000 eurot. Investeerimisühing X ja ühing Y tegutsevad oma arvel.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
2	Tehingu viitenumber	'12456771'	'39998776'
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	'2018-10-26T08:21:01Z'	'2018-10-26T08:21:01Z'
29	Kauplemisvolitused	'DEAL'	'DEAL'
30	Kogus	'2000000'	'2000000'
32	Tuletislepingu tingliku väärtuse suurenemine/vähenemine		
33	Hind	'100'	'100'
38	Ettemakse	'50000'	'50000'

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> <TxId>12456771</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> <TxId>39998776</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>

```
<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <LEI>12345678901234567890</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
        <TradDt>2018-10-26T08:21:01Z</TradDt>
        <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
        <Qty>
          <MntryVal
Ccy="EUR">2000000</MntryVal>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <BsisPts>100</BsisPts>
          </Pric>
        </Pric>
        ...
        <UpFrntPmt>
          <Amt Ccy="EUR">50000</Amt>
        </UpFrntPmt>
      </Tx>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

```
<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>12345678901234567890</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
        <TradDt>2018-10-
26T08:21:01Z</TradDt>
        <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
        <Qty>
          <MntryVal
Ccy="EUR">2000000</MntryVal>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <BsisPts>100</BsisPts>
          </Pric>
        </Pric>
        ...
        <UpFrntPmt>
          <Amt Ccy="EUR">50000</Amt>
        </UpFrntPmt>
      </Tx>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

Seejuures peab ettemakse (väli 38) väärtus olema nii investeerimisühingu X kui ka kaitse ostnud ühingu Y tehinguaruandes positiivne, sest see summa laekub krediidiriski vahetustehingu müüjale.

25. novembril 2018 kell 10.52.03 lepivad nimetatud krediidiriski vahetustehingu pooled kokku, et tinglikku väärtust suurendatakse 5 miljoni euroni ning selle eest tasutakse investeerimisühingule X täiendavalt 75 000 eurot. Kupongimaksed ei muutu.

Kuidas peavad investeerimisühingud X ja Y esitama aruannetes tingliku väärtuse suurenemise?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
2	Tehingu viitenumber	‘124567981’	‘399987981’
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-11-25T10:52:03Z’	‘2018-11-25T10:52:03Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’

30	Kogus	‘3000000’	‘3000000’
32	Tuletislepingu tingliku väärtuse suurenemine/vähenemine	‘INCR’	‘INCR’
33	Hind	‘100’	‘100’
38	Ettemakse	‘75000’	‘75000’

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> <TxId>124567981</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">3000000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>INCR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">75000</Amt> </UpFrntPmt> ... </Tx> … </New> </Tx>	<Tx> <New> <TxId>399987981</TxId> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">3000000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>INCR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">75000</Amt> </UpFrntPmt> ... </Tx> … </New>

	</Tx>

Selle tehinguaruande tehingu viitenumber (väli 2) on suurendamise korral kordumatu, mitte sama kui algses tehinguaruandes.

Kogus (väli 30) on summa, mille võrra tinglik väärtus suureneb. Kui pärast tingliku väärtuse muutust muutuvad ka kupongimaksed, tuleb uus kupong esitada hinna väljal (väli 33).

Seejuures on kuupäev ja kellaaeg suurendamise, mitte algse tehingu omad.

Algset tehinguaruannet ei peaks tühistama.

Algse tehingu aruanne ja tingliku väärtuse suurendamise aruanne näitavad üheskoos, et investeerimisühing X on oma vastaspoolele müünud 5 miljoni euro eest kaitset.

5.19.2 Tingliku väärtuse vähenemine

5.19.2.1 Osaline ennetähtaegne lõpetamine

48. näide

Sama kui eelmises näites, kuid pooled lepivad 25. novembril 2018 kell 10.52.03 tingliku väärtuse suurendamise asemel kokku tingliku väärtuse vähendamise 0,5 miljoni euro võrra 1,5 miljoni euroni ja investeerimisühing X tasub vähendamise eest 37 500 eurot.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
2	Tehingu viitenumber	‘124567852’	‘39998792’
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-11-25T10:52:03Z’	‘2018-11-25T10:52:03Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘500000’	‘500000’
32	Tuletislepingu tingliku väärtuse suurenemine/vähenemine	‘DECR’	‘DECR’
33	Hind	‘100’	‘100’
38	Ettemakse	‘37500’	‘37500’

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> <TxId>124567852</TxId>	<Tx> <New> <TxId>39998792</TxId>

<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">500000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>DECR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx>	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-11-25T10:52:03Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <MntryVal Ccy="EUR">500000</MntryVal> </Qty> <DerivNtnlChng>DECR</DerivNtnlChng> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> ... <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">37500</Amt> </UpFrntPmt> </Tx> ... </New> </Tx>

Ettemakse on mõlemas aruandes positiivne, sest ehkki investeerimisühing X on nüüd maksja, mitte makse saaja, on selles aruandes müüjaks Y, seega on müüja makse saajaks.

Et positsiooni vähendatakse ja investeerimisühing X oli algul müüja, on nüüd investeerimisühing X ostja.

Kogus (väli 30) on summa, mille võrra tinglik väärtus väheneb. Kui pärast tingliku väärtuse muutust muutuvad ka kupongimaksed, tuleb uus kupong esitada hinna väljal (väli 33).

Seejuures on kuupäev ja kellaaeg vähendamise, mitte algse tehingu omad.

Algse tehingu aruanne ja tingliku väärtuse vähendamise aruanne näitavad üheskoos, et investeerimisühing X on müünud 1,5 miljoni euro eest kaitset. Algset tehinguaruannet ei peaks tühistama.

5.19.3 Täielik ennetähtaegne lõpetamine

Kui pooled lepivad kokku, et leping lõpetatakse täielikult ennetähtaegselt, väheneb tinglik väärtus algse lepingu kogusumma võrra.

III osa. Kauplemisstsenaariumid

5.20 Väärtpaberite ülekandmine

5.20.1 Ülekandmine sama ühingu klientide vahel

Nagu I osas märgitud, ei tuleks tehinguaruannet esitada, kui aluseks oleva kliendi omandiõigus ei muutu. Seejuures ei ole oluline, kas ülekanne toimub sama investeerimisühingu piires või kahe eri investeerimisühingu vahel või investeerimisühingu ja ühingu vahel, kui omanikud on täpselt samad.

Kui investeerimisühing teeb kontode vahel ülekande, mille tulemuseks on tehing, loetakse ta vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 3 tehingu sooritanuks. Kui aga investeerimisühing osutab üksnes haldusabi ega soorita ülekannet, ei loeta ühingut tehingu sooritajaks.

Ülekanded kliendi kontolt ühiskontole, mille üks omanikke on sama klient, kuuluvad aruandekohustuse alla. Samuti tuleb esitada aruanne siis, kui ühiskonto muutub ühe omaniku kontoks.

See põhimõte kehtib kõigile ülekannetele ühisportfellidest üksikportfellidesse, fondidest makse saajatele tehtavatele jaotistele, ülekannetele vanemate valduskontodelt alaealistele nende täisealiseks saamisel, ülekannetele (või tagasimüükidele) füüsiliselt isikult äriühingule, mille omanik on see füüsiline isik, ülekannetele heategevuseks ja ülekannetele oksjonitelt või investeerimisühingult, kes viib kokku müüja ja ostja.

Aruandekohustuse alla kuuluvad ülekanded seoses liikumistega, mis on seotud surnud kliendi vara või pärandvara valitsemisega, oksjonitega ja kinkidega, sest nende ülekannete korral on tegu omandamiste või võõrandamistega, kui omanik muutub, isegi kui tehingul puudub hind, samuti väärtpaberikonto omandi üleminekul ühelt makse saajalt teisele.

Hinna väljale tuleks märkida tasutud hind, ehkki see võib erineda turuhinnast. Kui finantsinstrumente kantakse üle tasuta (nt kingid või fondide-/portfellidevahelised ülekanded), tuleks hinna väljale märkida ‘NOAP’.

<u>49. näide</u>

Klient A soovib kanda instrumente üle kliendi B kontole tasu saamata. Teenustasusid ei maksta. Mõlema kontod on samas investeerimisühingus (ühing X), kes ülekande sooritab.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes selle tehingu?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx> *— NB! Kui hind puudub, tuleks kasutada koodi NOAP.*
7	Ostja tunnuskood	Kliendi B {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
33	Hind	'NOAP'	

Aruandes esitatav kuupäev ja kellaaeg on investeerimisühingu X poolt ülekande sooritamise kuupäev ja kellaaeg.

5.20.2 Kahe eri investeerimisühingu klientide vaheline ülekanne

50. näide

Klient A soovib kanda 100 finantsinstrumenti oma kontolt investeerimisühingus X kliendi B kontole investeerimisühingus Y. Klient annab käsundi investeerimisühingule X ja see täidetakse 10. mail 2018 kell 09.53.17. Investeerimisühing X ega investeerimisühing Y ei tea üksteise klientide isikuid.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Kliendi B {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-10-05T09:53:17Z’	‘2018-10-05T09:53:17Z’
30	Kogus	‘100’	‘100’
33	Hind	‘NOAP’	‘NOAP’
34	Hinna valuuta		

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-10-05T09:53:17Z</TradDt> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <NoPric> <Pdg>NOAP</Pdg> </NoPric> </Pric> ... </Tx> ... </New> </Tx>

... </New> </Tx> *Note: NOAP code should be used when price is not applicable.*	*Note: NOAP code should be used when price is not applicable.*

Investeerimisühing X ja investeerimisühing Y peaksid aruandesse märkima oma ülekande sooritamise kuupäeva ja kellaaja, mis võivad olla erinevad. Väljale 28 (kauplemise kuupäev ja aeg) märgitakse tehingu kuupäev ja kellaaeg, mitte korralduse edastamise kuupäev ja kellaaeg.

5.20.3 Ühingud, kes viivad börsiväliselt kokku kaks kliendikorraldust

51. näide

Investeerimisühing X sooritab börsivälise tehingu kliendi A ehk ostja ja kliendi B ehk müüja vahel. Kummalgi kliendil ei ole tehinguaruandluse kohustust. Kauplemise kohta kehtib kauplemisjärgse teatamise kohustus ning börsivälise kauplemise järgse etapi indikaatoriks on 'ACTX' (vahendaja risttehing).

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ...
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kliendi B {LEI}	
36	Koht	'XOFF'	
63	Börsiväline kauplemisjärgne indikaator	'ACTX'	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd>

			… </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

52. näide

Investeerimisühing X sooritab börsivälise tehingu kliendi A ehk ostja ja kliendi B ehk müüja vahel. Klient B on investeerimisühing, kellel on tehinguaruandluse kohustus. Kliendil B puudub aluseks olev klient.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja B aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu B aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu B {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu B {LEI}	Investeerimisühingu B {LEI}
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘DEAL’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’
63	Börsiväline kauplemisjärgne indikaator	‘ACTX’	

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Tx>	<Tx> <New> … <ExctgPty>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ...

… <TradVn>XOFF</TradVn> … </Tx> <AddtlAttrbts> <OTCPstTradInd>ACTX</OTCPstTradInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <Tx> … <TradVn>XOFF</TradVn> … </Tx> ... </New> </Tx>

Kui klient A oli investeerimisühing, kellel oli tehinguaruandluse kohustus, pidanuks ta oma tehinguaruandes märkima müüjaks investeerimisühingu X.

5.21 Investeerimisühingute poolt edasisuunamine omapoolse vahenduseta

5.21.1 Investeerimisühing viib kokku kaks kliendikorraldust omapoolse vahenduseta

53. näide

Investeerimisühing X soovib müüa teatud instrumendi oma arvel.

Investeerimisühing Y soovib osta selle instrumendi oma arvel.

Investeerimisühing Z viib investeerimisühingud X ja Y kokku, kuid ei ole ise tehingu pooleks.

Investeerimisühingud X ja Y lepivad omavahel kokku tehingu üksikasjad.

Investeerimisühingul Z puudub aruandluskohustus, aruanded peaksid esitama ühingud X ja Y.

Investeerimisühing X teab sooritamise hetkel, et tema vastaspooleks on Y.

Investeerimisühing Y teab sooritamise hetkel, et tema vastaspooleks on X.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New>	<Tx> <New>

... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … </Tx> ... </New> </Tx>	... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> … <Tx> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … </Tx> ... </New> </Tx>

5.21.2 Investeerimisühing suunab kliendi teise investeerimisühingusse omapoolse vahenduseta

54. näide

Klient A soovib osta teatud instrumendi. Tema maakler ühing X seda liiki instrumentidega ei kauple ning ta suunab kliendi A investeerimisühingusse Y.

Investeerimisühing Y ostab kliendile A finantsinstrumente kauplemiskohas M. Investeerimisühing Y teab sooritamise hetkel, et tema klient on A, ja klient A teab, et tal on selles tehingus suhe investeerimisühinguga Y. Investeerimisühing X sooritamises ei osale ning saab investeerimisühingult Y üksnes komisjonitasu suunamise eest.

Et investeerimisühing X ei ole sooritaja, ei esita ühing tehinguaruannet.

Mis peab olema investeerimisühingu Y aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr>
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	

			<AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... </New> </Tx>

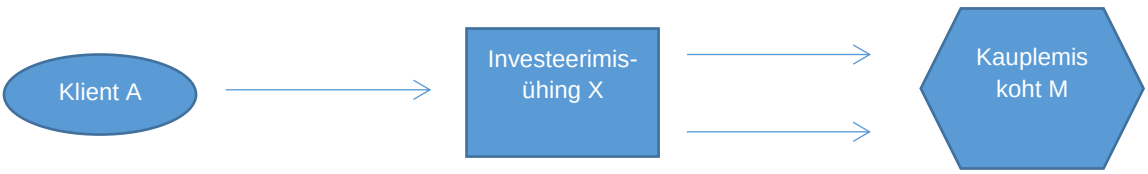
Kui klient A on investeerimisühing, peaks ka tema esitama aruande, märkides müüjaks investeerimisühingu Y.

See erineb komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 tingimustele vastavast edastamisest, sest siin stsenaariumis loob aluseks olev klient suhte ühinguga, kelle juurde ta suunati. Sisuliselt annab investeerimisühing X suhte üle investeerimisühingule Y. See erineb olukorrast, kus säilib suhe edastava ühinguga ning edastatakse üksnes kliendi andmed.

5.22 Ühe kliendi ühe korralduse täitmine mitme tehinguga

5.22.1 Kliendi korralduse täitmine kauplemiskohas tehingu sooritamise ja seejärel kliendi teenindamisega investeerimisühingu oma portfellist

55. näide



Client A	Klient A
Investment Firm X	Investeerimisühing X
Trading Venue M	Kauplemiskoht M

Klient A esitab investeerimisühingule X korralduse osta 500 aktsiat.

Investeerimisühing X täidab korralduse kauplemiskohas M kahe tehinguga, üks 24. juunil 2018 kell 14.25.13,159124, 300 aktsiat hinnaga 99 SEK, ja teine 24. juunil 2018 kell 15.55.13,746133, 200 aktsiat hinnaga 100 SEK. Klient soovib saada keskmise hinna.

a) Investeerimisühing X kaupleb oma arvel.

Tehingud tehakse kõigepealt investeerimisühingu X oma kontole ja seejärel samal päeval kell 16.24.12 kliendi kontole kaalutud keskmise hinnaga 99,40 SEK.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	'2018-06-24T14:25:13.159Z'	'2018-06-24T15:55:13.746Z'	'2018-06-24T16:24:12Z'
29	Kauplemisvolitused	'DEAL'	'DEAL'	'DEAL'
30	Kogus	'300'	'200'	'500'
33	Hind	'99'	'100'	'99.40'
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	'XOFF'

XML:

1. aruanne

```
<Tx>
  <New>
  ...
<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
    ...
    <Buyr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
<LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
<LEI>11111111111111111111</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
```

2. aruanne

```
<Tx>
  <New>
  ...

<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
    ...
    <Buyr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
<LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
<LEI>11111111111111111111</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
```

3. aruanne

```
<Tx>
  <New>
  ...

<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
    ...
    <Buyr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
<LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
```

... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:13.159Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> </New> </Tx>	</Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:13.746Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	</Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:24:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.4</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

b) Investeerimisühing kaupleb kliendikorralduste sobitamise teel

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	Kliendi A {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}
20	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-24T14:25:13.159’	‘2018-06-24T15:55:13.746’
29	Kauplemisvolitused	‘MTCH’	‘MTCH’
30	Kogus	‘300’	‘200’
33	Hind	‘99’	‘100’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}

XML:

1. aruanne	2. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr>

```
          <Id>
          <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <LEI>11111111111111111111</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
      ...
      <TradDt>2018-06-
24T14:25:13.159</TradDt>
        ...
        <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty>
        ...
        <Qty>
          <Unit>300</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="SEK">99</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        ...
        <TradVn>XMIC</TradVn>
        ...
      </Tx>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

```
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>11111111111111111111</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
      ...
      <TradDt>2018-06-
24T15:55:13.746</TradDt>
        ...
        <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty>
        ...
        <Qty>
          <Unit>200</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="SEK">100</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        ...
        <TradVn>XMIC</TradVn>
        ...
      </Tx>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

Ehkki klient soovib keskmist hinda, peavad tehinguaruanded kajastama, et iga üksik turutehing kandub viivitamata üle kliendile, sest investeerimisühing tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel.

c) Investeerimisühing kaupleb „muu volituse alusel“

„Muu volituse alusel“ kaupleva investeerimisühingu X tehinguaruanded on täpselt samad kui kliendikorralduste sobitamise teel kauplemise aruanded eespool, v.a kauplemisvolitus, mis esitatakse ‘MTCH’ asemel kujul ‘AOTC’.

5.22.2 Kliendi korralduse täitmine instrumentide osalise omandamisega kauplemiskohast ja kliendi teenindamisega investeerimisühingu oma portfellist

56. näide

Klient A esitab investeerimisühingule X korralduse osta 600 aktsiat. Klient soovib saada keskmise hinna.

Investeerimisühing X täidab kliendi A korralduse järgmiselt:

1) ta teeb kauplemiskohas M kaks tehingut, ühe 24. juunil 2018 kell 14.25.13,159124, 300 aktsiat hinnaga 99 SEK, ja teise 24. juunil 2018 kell 15.55.13,746133, 200 aktsiat hinnaga 100 SEK.

2) Investeerimisühing X kannab samal päeval kell 16.24.12 kliendile 600 aktsiat keskmise hinnaga 99,416 SEK.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
20	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-24T14:25:13.159Z’	‘2018-06-24T15:55:13.746Z’	‘2018-06-24T16:24:12Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘300’	‘200’	‘600’
33	Hind	‘99’	‘100’	‘99,4166666666666’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’

XML:

1. aruanne (turupool)	2. aruanne (turupool)	3. aruanne (kliendipool)
<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>	<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>

</AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:13.159Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:13.746Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">100</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T16:24:12Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>600</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.4166666666666</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

5.23 Korralduste grupeerimine

Klientide koondkontot (‘INTC’) tuleks kasutada üksnes käesolevate suunistega ette nähtud olukordades. Seda ei peaks kasutama aruande esitamiseks ühe kliendi ühe korralduse kohta, mis täidetakse ühe sooritusega, või ühe kliendi ühe korralduse kohta, mis täidetakse mitme sooritusega. Kui toimub kanne klientide koondkontole (‘INTC’), peaks samal päeval toimuma ka vastav kanne tehinguaruandes märgitud sooritava isiku klientide koondkontolt, et klientide koondkonto seis püsiks muutumatuna. Näiline liikumine ‘INTC’ kaudu on aruandluskonstruktsioon, millega seostatakse tehingute turupool ja kliendipool, ning see ei tähenda, et selline kliendikonto on tegelikult olemas või et instrumendi omand antakse tegelikult üle investeerimisühingu portfelli kaudu.

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 11 lõikes 2 on sätestatud, et määruse (EL) nr 236/2012 kohased lühikeseks müügi nõuded kehtivad juhul, kui investeerimisühing koondab eri klientide korraldusi. See tähendab, et komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 11 lõiget 2 kohaldatakse üksnes aruannetele, mis kajastavad tehinguid üksikklientidega, mitte aga turutehingute koondaruandele. Turutehingute aruande puhul, milles koondatakse klientide müügitehinguid, tuleb jätta lühikeseks müügi indikaator tühjaks. Põhjus on, et turutehingute koondaruanne käsitleb kõiki kliente, kelle korraldused on koondatud, mistõttu lühikeseks müügi indikaatorit ei saa märkida piisava ajalise detailsusega. Selle asemel esitatakse üksikklientide lühikeseks müügi indikaator eraldi kliendipoole tehinguaruannetes (vt punktid 5.24 ja 5.27.2).

5.23.1 Üks turutehing mitme kliendi nimel

57. näide

Investeerimisühingu X kaks klienti, klient A ja klient B, esitavad vastavalt 100 ja 200 aktsia müügikorraldused.

Klient A müüb lühikeseks. Klient B ei soovi investeerimisühingule X avaldada, kas ta müüb lühikeseks. Investeerimisühingu X positsioon ei muutu. Investeerimisühing X koondab korraldused ja sooritab need 16. septembril 2018 kell 09.20.15,374215 kauplemiskohas M ühe tehinguga, 300 hinnaga 25,54 EUR. See jaotatakse klientide vahel kell 09.35.10.

5.23.1.1 Investeerimisühing X kaupleb oma arvel.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-16T09:20:15.374Z’	‘2018-09-16T09:35:10Z’	‘2018-09-16T09:35:10Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘300’	‘100’	‘200’
33	Hind	‘25.54’	‘25.54’	‘25.54’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’
62	Lühikeseks müügi indikaator	‘SESH’	‘SESH’	‘UNDI’

XML:

1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne
<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id>

</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> ... <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:35:10Z</TradDt> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> … <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> …. </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-16T09:35:10Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> … <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>UNDI</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Et turule müük tekitaks investeerimisühingule X lühikese positsiooni, peaks investeerimisühing X selle kajastamiseks täitma 1. aruande olenemata sellest, et pärast oste klientidelt oleks investeerimisühingu X positsioon muutumatu (vt 5.27.2).

5.23.1.2 Investeerimisühing X kaupleb „muu volituse alusel“

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes

4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	‘INTC’	‘INTC’
16	Müüja tunnuskood	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-16T09:20:15.374Z’	‘2018-09-16T09:20:15.374Z’	‘2018-09-16T09:20:15.374Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘300’	‘100’	‘200’
33	Hind	‘25.54’	‘25.54’	‘25.54’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’
62	Lühikeseks müügi indikaator		‘SESH’	‘SELL’

XML:

1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-16T09:20:15.374Z</TradDt> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric>

<Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>	<Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> … <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> … <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Kauplemise hind ning kuupäev ja kellaaeg peaksid olema kõigis kolmes tehinguaruandes samad. Kauplemise hind ning kuupäev ja kellaaeg peaksid olema turuhind ning kuupäev ja kellaaeg turutehingu aja seisuga. Aruanded 2 ja 3 kajastavad kauplemiskohas „muu volituse alusel“ sooritatud tehinguga omandatu jaotamist klientidele. Seepärast peaks turutehingu sooritamise kuupäeva ja kellaaja detailsus olema klientidele jaotamise aruannetes sama.

5.23.2 Mitu turutehingut mitme kliendi nimel

58. näide

Investeerimisühingu X kolm klienti – klient A, klient B ja klient C – esitavad ostukorraldused vastavalt 100, 200 ja 300 instrumendile.

Investeerimisühing X on nõustunud pakkuma klientidele keskmist hinda hing koondab nimetatud korraldused, täites need kahe tehinguga kauplemiskohas M, üks 400 hinnaga 99 SEK (kuupäev ja kellaeg: 15. september 2018 kell 11.32.27,431) ja teine 200 hinnaga 100 SEK (kuupäev ja kellaaeg: 15. september 2018 kell 11.42.54,192). Ta jaotab tehingutega saadu klientidele samal päeval kell 12:15:23.

5.23.2.1 Investeerimisühing X kaupleb oma arvel.

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes turupoole tehingud?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}

28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’	‘2018-09-15T11:42:54.192Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘400’	‘200’
33	Hind	‘99’	‘100’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}

XML:

1. aruanne

```
<Tx>
  <New>
  ...
<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
    ...
    <Buyr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
          <LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
          <LEI>11111111111111111111</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    ...
    <Tx>
      <TradDt>2018-09-
15T11:32:27.431Z</TradDt>
      <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
      <Qty>
        <Unit>400</Unit>
      </Qty>
      <Pric>
        <Pric>
          <MntryVal>
            <Amt Ccy="SEK">99</Amt>
          </MntryVal>
        </Pric>
      </Pric>
      ...
      <TradVn>XMIC</TradVn>
      ...
    </Tx>
    ...
  </New>
</Tx>
```

2. aruanne

```
<Tx>
    <New>
    ...

<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgP
ty>
      ...
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>12345678901234567890</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>11111111111111111111</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ..
      <Tx>
        <TradDt>2018-09-15T11:42:54.
192Z</TradDt>
        <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
        <Qty>
          <Unit>200</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="SEK">100</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        ...
        <TradVn>XMIC</TradVn>
        ...
      </Tx>
      ...
    </New>
```

	</Tx>

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes tehingud klientidega?

Nr	Andmeväli	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes	Väärtused 5. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}	Kliendi C {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-15T12:15:23Z’	‘2018-09-15T12:15:23Z’	‘2018-09-15T12:15:23Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘100’	‘200’	‘300’
33	Hind	‘99.3333333333333’	‘99.3333333333333’	‘99.3333333333333’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

3. aruanne	4. aruanne	5. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T12:15:23Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty>

<Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>	<Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>	<Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... </New> </Tx>

Et investeerimisühing X kaupleb oma arvel, kajastavad kliendipoole aruannete kuupäev ja kellaaeg aegu, mil finantsinstrumendid klientidele jaotati.

5.23.2.2 Investeerimisühing X kaupleb „muu volituse alusel“

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes turupoole tehingud?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’	‘2018-09-15T11:42:54.192Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘400’	‘200’
33	Hind	‘99’	‘100’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}

XML:

1. aruanne	2. aruanne
<Tx> <New> … <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr>	<New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr>

```
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <LEI>11111111111111111111</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <Tx>
        <TradDt>2018-09-
15T11:32:27.431Z</TradDt>
        <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        <Qty>
          <Unit>400</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="SEK">99</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        <TradVn>XMIC</TradVn>
      </Tx>
    </New>
  </Tx>
```

```
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <LEI>11111111111111111111</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
        <TradDt>2018-09-
15T11:42:54.192Z</TradDt>
        <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        <Qty>
          <Unit>200</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="SEK">100</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        <TradVn>XMIC</TradVn>
      </Tx>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes klientidele jaotamise?

Nr	Andmeväli	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes	Väärtused 5. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}	Kliendi C {LEI}
16	Müüja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’	‘INTC’
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘100’	‘200’	‘300’
33	Hind	‘99.3333333333333’	‘99.3333333333333’	‘99.3333333333333’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

3. aruanne	4. aruanne	5. aruanne
<Tx> <New>	<Tx> <New>	<Tx> <New>

... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333’</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.3333333333333’</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">99.333333333333’</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

Turutehingu sooritamise kuupäeva ja kellaaja detailsus peaks klientidele jaotamise aruannetes olema sama, sest tehingud sooritati kauplemiskohas „muu volituse alusel“.

Kui investeerimisühing X kaupleb „muu volituse alusel“, on klientidele jaotamisel kauplemise kuupäev ja kellaaeg esimese, mitte viimase turutehingu kuupäev ja kellaaeg.

5.23.2.3 Investeerimisühing X sooritab kliendikorralduste sobitamistehingut

Investeerimisühing X ei saa väljadele märkida ‘MTCH’, kui sooritab tehinguid eri kauplemisaegadel.

5.23.2.4 Investeerimisühing X kaupleb mitmesuguste kauplemisvolituste alusel

59. näide

Sama kui eelmises näites, kuid investeerimisühing X täidab osa korraldusest oma portfellist (200 ühikut hinnaga 100 SEK). Et klientide koondkonto (‘INTC’) peab olema päeva lõpuks muutumatu ja ühing X kannab üle 200 ühikut, et osaliselt täita mitme kliendi korraldused, tuleb esitada aruanne ülekande kohta ühingu X oma kontolt ‘INTC’ kontole, et turupoole ja klientidele jaotamise poole kogused oleksid samad (2. aruanne).

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes turupoole tehingud?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’	‘2018-09-15T11:35:30Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘DEAL’
30	Kogus	‘400’	‘200’
33	Hind	‘99’	‘100’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’

XML:

1. aruanne	2. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:35:30Z </TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>

```
        <TradDt>2018-09-
15T11:32:27.431Z</TradDt>
        <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        <Qty>
          <Unit>400</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="SEK">99</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        <TradVn>XMIC</TradVn>
      </Tx>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

```
        <Qty>
          <Unit>200</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="SEK">100</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        <TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes klientidele jaotamise?

Nr	Andmeväli	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes	Väärtused 5. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}	Kliendi C {LEI}
16	Müüja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’	‘INTC’
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’	‘2018-09-15T11:32:27.431Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘100’	‘200’	‘300’
33	Hind	‘99.3333333333333’	‘99.3333333333333’	‘99.3333333333333’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

3. aruanne	4. aruanne	5. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id><LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr>

<AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">93.3333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">93.3333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-09-15T11:32:27.431Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="SEK">93.3333333333333</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

Klientidele jaotamisel on kauplemise kuupäev ja kellaaeg esimese turutehingu kuupäev ja kellaaeg. Turutehingu sooritamise kuupäeva ja kellaaja detailsus peaks klientidele jaotamise aruannetes olema sama, sest tehingud sooritati kauplemiskohas „muu volituse alusel“.

5.23.2.5 Mitme tehingu sooritamine eri päevadel, kui investeerimisühing X kaupleb „muu volituse alusel“

60. näide

Investeerimisühing X saab 24. juulil 2018 korraldused osta kliendile A 400 ja kliendile B 600. Korraldus täidetakse kolmes osas järgmiselt:

200 ühikut 24. juulil 2018 kell 15.33.33 hinnaga 100,21 eurot (vastaspool on investeerimisühing Y);

300 ühikut 24. juulil 2018 kell 17.55.55 hinnaga 100,52 eurot (vastaspool on investeerimisühing Z);

500 ühikut 25. juulil 2018 kell 13.11.11 hinnaga 100,96 eurot (vastaspool on investeerimisühing V, kelle LEI on VVVVVVVVVVVVVVVVVVV).

Kuidas peab investeerimisühing X esitama aruandes turupoole tehingud ja hilisema jaotamise?

5.23.2.5.1 Kliendid saavad keskmise hinna

Ehkki tellimus ei ole lõpuni täidetud, on iga päeva lõpus toimunud klientidele jaotamine, sest ‘INTC’ kontol ei saa kajastada mitme päeva positsiooni muutusi.
Vastavalt investeerimisühingu X sise-eeskirjadele tuleb kliente kohelda võrdselt, seega ei saa ühtki neist eelistada.

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	‘INTC’	‘INTC’
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-24T15:33:33Z’	‘2018-07-24T17:55:55Z’	‘2018-07-24T15:33:33Z’	‘2018-07-24T15:33:33Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘200’	‘300’	‘250’	‘250’
33	Hind	‘100.21’	‘100.52’	‘100.396’	‘100.396’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne	4. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx>

<TradDt>2018-07-24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<TradDt>2018-07-24T17:55:55Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.52</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<TradDt>2018-07-24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.396</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<TradDt>2018-07-24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.396</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

25. juulil 2018 sooritatud tehingu korral:

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Ühingu V {LEI}	‘INTC’	‘INTC’
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-25T13:11:11Z’	‘2018-07-25T13:11:11Z’	‘2018-07-25T13:11:11Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘500’	‘150’	‘350’
33	Hind	‘100.96’	‘100.96’	‘100.96’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...

<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>VVVVVVVVVVVVVVVVVV</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

5.23.2.5.2 Korraldused täidetakse nende saabumise järjekorras

Ühingu X sise-eeskirjade kohaselt kehtib koondtehingute korral klientidele jaotamisel ajaprioriteet. Et investeerimisühing X sai kliendi A korralduse esimesena, saab klient A kõik soovitud instrumendid (400 keskmise hinnaga 100,365 EUR), millega tema korraldus on täielikult täidetud. Ülejäänud osa tehinguga saadust läheb kliendile B.

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}

16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	‘INTC’	‘INTC’
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-24T15:33:33Z’	‘2018-07-24T17:55:55Z’	‘2018-07-24T15:33:33Z’	‘2018-07-24T15:33:33Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘200’	‘300’	‘400’	‘100’
33	Hind	‘100.21’	‘100.52’	‘100.365’	‘100.52’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne	4. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.21</Amt>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-24T17:55:55Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.52</Amt>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-24T15:33:33Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>

</MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	</MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Amt Ccy="EUR">100.365</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>	<Amt Ccy="EUR">100.52</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... </New> </Tx>

25. juulil 2018 sooritatud tehinguga saadu läheb kliendile B ja 'INTC' kontot ei kasutata.

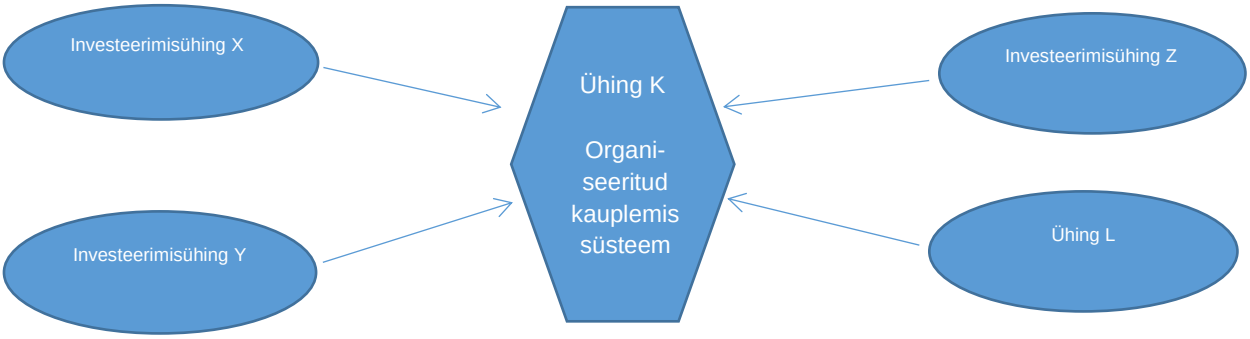
Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>VVVVVVVVVVVVVVVVVVV</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-07-25T13:11:11Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">100.96</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx>
7	Ostja tunnuskood	Kliendi B {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Ühingu V {LEI}	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	'2018-07-25T13:11:11Z'	
29	Kauplemisvolitused	'AOTC'	
30	Kogus	'500'	
33	Hind	'100.96'	
36	Koht	'XOFF'	

			... </New> </Tx>

5.24 Organiseeritud kauplemissüsteem tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel

Kui organiseeritud kauplemissüsteem tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel, tegutseb ta sarnasel viisil kui investeerimisühing ja esitab aruandeid sarnasel viisil kui investeerimisühing. Kõik organiseeritud kauplemissüsteemiga tehinguid sooritavad pooled märgivad koha väljale organiseeritud kauplemissüsteemi segmendi MIC-tunnuskoodi. Kliendikorralduste sobitamise teel tegutsev organiseeritud kauplemissüsteem sobitab ühe või mitme kliendi ostukorraldused ühe või mitme kliendi müügikorraldustega.

61. näide



Investeerimisühing K on organiseeritud kauplemissüsteem, kelle LEI on OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT ja segmendi MIC OTFX ning kes tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel oma algoritmi alusel, mille kood on ‘1234ABC’, ning kes viib kokku kahe investeerimisühingu – ühingu X ja ühingu Y – riigivõlakirjade ostukorraldused ning kahe teise investeerimisühingu – ühingu Z ja investeerimisühingu L – kaks müügikorraldust. Ühingu L LEI on 77777777777777777777.

Investeerimisühingud X ja Y ostavad vastavalt 300 ja 100 riigivõlakirja ning investeerimisühingud Z ja L müüvad vastavalt 150 ja 250 riigivõlakirja.

Investeerimisühingud X, Y, Z ja L tegutsevad kõik oma arvel. Investeerimisühingus X tegi investeerimisotsuse ja sooritas tehingu kaupleja 1. Investeerimisühingus Y tegi investeerimisotsuse ja sooritas tehingu kaupleja 4. Investeerimisühingus Z tegi investeerimisotsuse ja sooritas tehingu kaupleja 5. Ühingus L tegi investeerimisotsuse ja sooritas tehingu kaupleja 9. Kaupleja 9 on Patrick Down, Iirimaa kodanik, sünnikuupäev 14. juuli 1960.

Investeerimisühing K viib korraldused kokku 9. juunil 2018 kell 16.41.07,1234Z hinnaga 42,7 EUR.

Investeerimisühing Z müüb lühikeseks ilma erandita, ühing L ei müü lühikeseks.

Mis peab olema investeerimisühingu K (organiseeritud kauplemissüsteem) aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu K {LEI}	Investeerimis-ühingu K {LEI}	Investeerimis-ühingu K {LEI}	Investeerimis-ühingu K {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	‘INTC’	‘INTC’
16	Müüja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu L {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’
29	Kauplemis-volitused	‘MTCH’	‘MTCH’	‘MTCH’	‘MTCH’
30	Kogus	‘300’	‘100’	‘150’	‘250’
33	Hind	‘42.7’	‘42.7’	‘42.7’	‘42.7’
36	Koht	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemissüsteemi segmendi {MIC}	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemissüsteemi segmendi {MIC}	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemissüsteemi segmendi {MIC}	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemissüsteemi segmendi {MIC}
59	Ühingusisene täitmine	{Algoritmi kood}	{Algoritmi kood}	{Algoritmi kood}	{Algoritmi kood}
62	Lühikeseks müügi indikaator			‘SESH’	‘SELL’

XML:

1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne	4. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> <Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>77777777777777777777</LEI>

</Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Algo>1234ABC</Algo> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Et selles näites on mõlemal poolel mitu klienti, tuleb ostu- ja müügipoole seostamiseks kasutada klientide koondkontot ‘INTC’. Vt punkt 5.23.

Kuidas peavad organiseeritud kauplemissüsteemi kliendid esitama aruandes sooritatud tehingud?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu L {LEI}

7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu K {LEI}	Investeerimis-ühingu K {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu K{LEI}	Investeerimis-ühingu K {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu L {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’	‘2018-06-09T16:41:07.123Z’
29	Kauplemis-volitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘300’	‘100’	‘150’	‘250’
33	Hind	‘42.7’	‘42.7’	‘42.7’	‘42.7’
36	Koht	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemis-süsteemi segmendi {MIC}	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemis-süsteemi segmendi {MIC}	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemis-süsteemi segmendi {MIC}	Investeerimis-ühingu K / organiseeritud kauplemis-süsteemi segmendi {MIC}
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 5 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 7 {RIIKLIK_TUNNUS}
62	Lühikeseks müügi indikaator			‘SESH’	‘SELL’

XML:

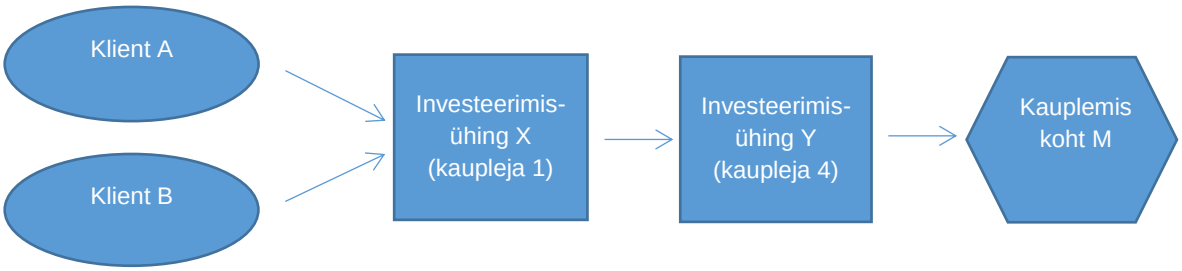
1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne	4. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>77777777777777777777</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>OTFOTFOTFOTFOTFOTFOT</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>77777777777777777777</LEI> </Id> </AcctOwnr>

... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>300</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>FI1234567890A</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-09T16:41:07.123Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">42.7</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>OTFX</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> ... <Othr> <Id>IE19600714PATRIDOWN#</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

5.25 Väärtuspõhised tehingud tasakaalustusühikuga

See võib toimuda siis, kui investeerimisühingud pakuvad jaeklientidele kulutõhusat päevapõhiste koondtehingute võimalust.

62. näide



Kaks Hispaania investeerimisühingu X klienti otsustavad osta sama finantsinstrumenti, klient A 400 euro eest ja klient B 200 euro eest. Kaupleja 1 esitab koondkorralduse väärtusega 600 eurot investeerimisühingule Y. Kaupleja 4 täidab korralduse kauplemiskohas M ühe tehinguga 24. juunil 2018 kell 14.25.30,1264, ostes 5 ühikut instrumenti hinnaga 120 eurot, ning kinnitab investeerimisühingule X, et korraldus on lõpuni täidetud. Investeerimisühing X jaotab neist 3 ühikut väärtusega 360 eurot kliendile A ja 1 ühiku väärtusega 120 eurot kliendile B. Tasakaalustusühiku ehk ühe instrumendi jaotab investeerimisühingu X süsteem (ALGOABC) oma kontole, et see võimaluse korral müüa. See omandamine on pigem halduslik kui sihipärane investeering.

Investeerimisühing X ei vasta komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud korralduste edastamise tingimustele.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes	Väärtused 4. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}
12	Ostja otsustaja				
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	‘INTC’	‘INTC’	‘INTC’
21	Müüja otsustaja kood				
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-24T14:25:30Z’	‘2018-06-24T14:25:30Z’	‘2018-06-24T14:25:30Z’	‘2018-06-24T14:25:30Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘DEAL’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘5’	‘1’	‘3’	‘1’
33	Hind	‘120’	‘120’	‘120’	‘120’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

57	Ühingusisene investeerimisotsus		{Algoritmi kood}		
58	Investeerimis-otsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik				
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	{Algoritmi kood}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	'ES'		'ES'	'ES'

XML:

1. aruanne Turupool	2. aruanne Kliendipool	3. aruanne Kliendipool	4. aruanne Kliendipool
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>3</Unit>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>1</Unit>

<Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA111222333445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Algo>ALGOABC</Algo> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Algo>ALGOABC</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA111222333445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	</Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">120</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>ES</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA111222333445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

2. aruandes on väljad 58 ja 60 tühjad, sest väljadele 57 ja 59 on märgitud algoritm. 1., 3. ja 4. aruandes on ühingusisese investeerimisotsuse väli (väli 57) tühi, sest investeerimisühing X tegutseb „muu volituse alusel“; et filiaale ei osalenud, märgitakse väljale 60 investeerimisühingu X riigikood (ES).

Sama olukord võib tekkida, kui investeerimisühing tegutseb kliendi nimel kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel.

Tasakaalustusühikuga seotud aruandes märgitakse väljale 57 ühingu algoritmi kood, sest otsus tehti ühingus, kuid seda ei teinud füüsiline isik.

5.26 Aruandlusahelad ja edastamine

See punkt sisaldab järgmiste olukordade näiteid:

a) ahelad, kus artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused ei ole täidetud (alapunkt **Error! Reference source not found.**);

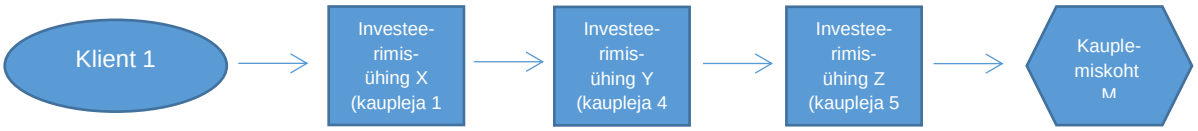
b) ahelad, kus artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused on täidetud, kuid mitte kõik teised artikli 4 tingimused (alapunkt 5.26.2);

c) ahelad, kus toimub edastamine ja komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud tingimused on kõigi investeerimisühingute korral täidetud (alapunkt 5.26.3);

d) ahelad, kus komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud tingimused on mõne investeerimisühingu korral täidetud (alapunkt 5.26.4).

Üldised selgitused ahelate ja edastamise kohta on I osa peatüki **Error! Reference source not found.** asjakohastes punktides.

63. näide



Klient 1, kes on investeerimisühingu X klient, otsustab müüa aktsiaid ja annab käsundi investeerimisühingule X. Kaupleja 1 otsustab kliendi 1 korralduse vastu võtta ja otsustab saata korralduse investeerimisühingule Y. Kaupleja 4 otsustab investeerimisühingu X korralduse vastu võtta ja otsustab saata korralduse investeerimisühingule Z. Investeerimisühingu Z kaupleja 5 otsustab investeerimisühingu Y korralduse vastu võtta ja investeerimisühingu Z algoritm ALGO valib korralduse sihtkohaks kauplemiskoha M. Seejärel täidab investeerimisüh ing Z korralduse kauplemiskoha M tellimusraamatus 1. juulil 2018 kell 13.40.23,4672 hinnaga 32,5 eurot. Kauplemiskoht M määrab tehingule tunnuskoodi ‘1234’.

5.26.1 Ahelad, kus artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused ei ole täidetud

Järgmine näide kirjeldab tehinguaruannete vormistamist ahelates, kus ei ole täidetud artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused ning iga investeerimisühing esitab aruande oma vahetu vastaspoole või kliendi kohta, samuti väljade 25–27 täitmist sellise stsenaariumi korral. See toimub siis, kui investeerimisühing kaupleb kliendikorralduste sobitamise teel või oma arvel. Seda liiki ahela üldine kirjeldus on suuniste I osa punktis 5.3.2.

64. näide

Investeerimisühingud Y ja Z kauplevad kliendikorralduste sobitamise teel ning investeerimisühing X kaupleb oma arvel.

Mis peab olema investeerimisühingute X, Y ja Z aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeeri-misühingu Z 1. aruandes	Väärtused investeeri-misühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeeri-misühingu X 1. aruandes	Väärtused investeeri-misühingu X 2. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’			
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis ühingu Z {LEI}	Investeerimis ühingu Y {LEI}	Investeerimis ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemis-koha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis ühingu Z {LEI}	Investeerimis ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis ühingu Y {LEI}	Investeerimis ühingu X {LEI}	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’	‘false’	‘false’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood				
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood				
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-01T13:40:23.467Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’
29	Kauplemisvolitused	‘MTCH’	‘MTCH’	‘DEAL’	‘DEAL’
33	Hind	‘32.5’	‘32.5’	‘32.5’	‘32.5’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemis-koha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’
57	Ühingusisene investeerimisotsus			Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
59	Ühingusisene täitmine	‘{Algoritmi kood}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}

XML:

Investeerimis-ühingu Z 1. aruanne	Investeerimis-ühingu Y 1. aruanne	Investeerimis-ühingu X 1. aruanne	Investeerimis-ühingu X 2. aruanne
<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...	<Tx> <New> ...

<ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> ... </Tx>	<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr>	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> … <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ...	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn>

... <ExctgPrsn> <Algo>ALGO12345</Algo> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>CA11122233344455555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>CA11122233344455555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	<Prsn> <Othr> <Id>CA11122233344455555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>CA11122233344455555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

Väli 25: ükski ühing ei ole korraldusi edastanud, sest kõik kauplevad oma arvel või kliendikorralduste sobitamise teel, mistõttu kõik märgivad sellele väljale ‘false’.

Väli 26 ja 27: need väljad täidab vastuvõttev investeerimisühing üksnes siis, kui on täidetud edastamise tingimused. Et sel juhul ei ole tingimused täidetud, on väljad tühjad.

Sama tehingu iga kauplemispaari ajad ja hinnad peavad kattuma (nt investeerimisühingu Z aruandes esitatud tehingu aeg investeerimisühinguga Y peaks olema sama, mille on aruandes esitanud investeerimisühing Y investeerimisühinguga Z), kuid ühingute ajalise detailsuse nõuded võivad olla erinevad – vt punkt 7.2 (ajatempli detailsus). Vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 väljale 28 tuleb komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklis 3 ja tabelis 2 sätestatud detailsusnõuete kohaselt esitada ainult kauplemiskoha turupoole aruanne, seega peavad X ja Y aruanded olema üksnes sekundi detailsusega (ehkki detailsus tohib olla ka suurem). Investeerimisühing X võib aruandes esitada sooritamise aja, mille on talle kinnitanud investeerimisühing Y. Aeg ja koht, mille investeerimisühing X esitab aruandes kliendiga 1 kauplemise kohta, võivad erineda ajast ja hinnast, mille investeerimisühing X esitab aruandes tehingu kohta

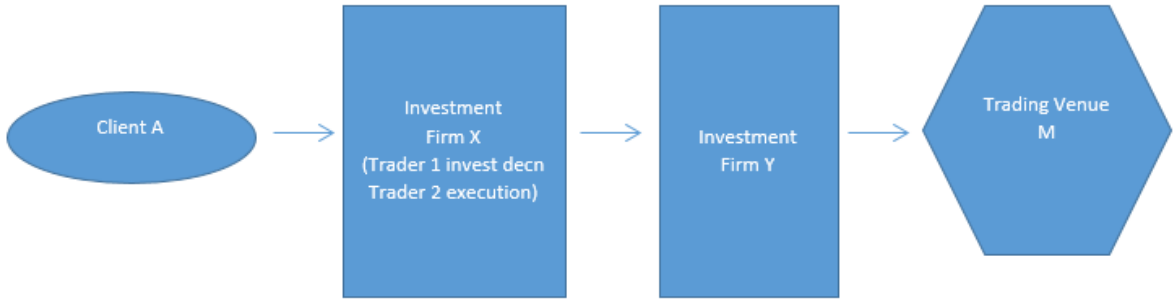
investeerimisühinguga Y, sest aktsiate jaotamine kliendile võib toimuda turu vastaspoolega tehingu tegemise ajast erineval ajal ja erineva hinnaga.

5.26.2 Ahelad, kus artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused on täidetud, kuid mitte kõik teised artikli 4 tingimused

Järgmised näited osutavad, et ahelates, kus artikli 4 lõike 1 punktide a ja b tingimused on täidetud, kuid mitte kõik teised artikli 4 tingimused, toimub aruannete esitamine põhimõtteliselt samamoodi kui ahelates, kus kõik artikli 4 tingimused on täitmata, v.a välja 25 korral.

5.26.2.1 Lihtahel

65. näide



Client A	Klient A
Investment Firm X (Trader 1 invest decn Trader 2 execution)	Investeerimisühing X (Kaupleja 1 investeerimisotsus Kaupleja 2 sooritaja)
Investment Firm Y	Investeerimisühing Y
Trading Venue M	Kauplemiskoht M

Kaupleja 1 teeb kliendi A kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel otsuse finantsinstrumendi ostmiseks kliendile A ja kaupleja 2 esitab instrumendi ostmiseks korralduse investeerimisühingule Y. Investeerimisühing Y, kes tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel, täidab korralduse kauplemiskohas M 1. juunil 2018 kell 14.51.09,123 hinnaga 32,5 eurot, kasutades algoritmi tunnuskoodiga ‘ALGO12345’.

Kauplemiskoht M määrab tehingule tunnuskoodi ‘1234’.

Mis peab olema investeerimisühingute Y ja X aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes	Väärtused investeerimisühingu X aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’	

4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}
12	Ostja otsustaja kood		Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
25	Korralduse indikaatori edastamine	'false'	'true'
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood		
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood		
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	'2018-06-01T14:51:09.123Z'	'2018-06-01T14:51:09Z'
29	Kauplemisvolitused	'MTCH'	'AOTC'
33	Hind	'32.5'	'32.5'
34	Hinna valuuta	'EUR'	'EUR'
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	'XOFF'
57	Ühingusisene investeerimisotsus		Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
59	Ühingusisene täitmine	{Algoritmi kood}	Kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}

XML:

Investeerimisühingu Y aruanne	Investeerimisühingu X aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn>

```
      <Tx>
        <TradDt>2018-06-
01T14:51:09.123Z</TradDt>
        <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty>
        ...
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        ...
        <TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
      </Tx>
      …
      <ExctgPrsn>
          <Algo>ALGO12345</Algo>
        </ExctgPrsn>
        …
    </New>
  </Tx>
```

```
      <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd>
    </OrdrTrnsmssn>
    <Tx>
      <TradDt>2018-06-01T14:51:09Z</TradDt>
      <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
      ...
      <Pric>
        <Pric>
          <MntryVal>
            <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
          </MntryVal>
        </Pric>
      </Pric>
      <TradVn>XOFF</TradVn>
    </Tx>
    …
    <InvstmtDcsnPrsn>
      <Prsn>
        …
        <Othr>
          <Id>CA1112223334445555</Id>
          <SchmeNm>
            <Cd>CCPT</Cd>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </InvstmtDcsnPrsn>
    <ExctgPrsn>
      <Prsn>
        …
        <Othr>
          <Id>GBAB123456C</Id>
          <SchmeNm>
            <Cd>NIDN</Cd>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </ExctgPrsn>
    …
  </New>
</Tx>
```

Investeerimisühing Y ei otsi investorit investeerimisühingust X kaugemalt ning märgib aruandes ostjaks investeerimisühingu X. Samamoodi ei otsi investeerimisühing X investorit investeerimisühingust Y kaugemalt ning märgib aruandes kohaks ‘XOFF’.

Investeerimisühingu X tehinguaruandes märgitakse väljale 25 ‘true’, sest ühing edastab korralduse, ehkki ta ei vasta komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 tingimustele. Samal põhjusel on väljad 26 ja 27 tühjad.

Kui investeerimisühing X ei oleks investeerimisühing ega saaks seepärast edastamist ühelgi tingimusel kohaldada, saaks pädev asutus üksnes investeerimisühingu Y aruande.

5.26.2.2 Pikem ahel

66. näide

Järgmine näide põhineb samal stsenaariumil, mida on kirjeldatud punkti 5.26 alguses, ent investeerimisühingud X, Y ja Z tegutsevad „muu volituse alusel“.

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu Z aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Y aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’		
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Kliendi A {LEI}
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘true’	‘true’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood			
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood			
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-01T13:40:23.467Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
33	Hind	‘32.5’	‘32.5’	‘32.5’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

Investeerimisühingu Z aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne	Investeerimisühingu X aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>

```
<LEI>11111111111111111111</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        ...
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        ...
        <TradVn>XMIC</TradVn>
        ...

<TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
        ...
      </Tx>
    …
  </New>
</Tx>
```

```
<LEI>88888888888888888888</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>12345678901234567890</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        …
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      …
    </New>
  </Tx>
```

```
<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

    <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        ...
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
        ...

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      …
    </New>
  </Tx>
```

Aeg peaks olema kõigis aruannetes sama, v.a ühingute erinevad detailsusnõuded – vt punkt 7.2 (ajatemplite detailsus). Põhjus on, et kõik ühingud tegutsevad muu volituse alusel ning kõik aruanded käsitlevad sama tehingut. Üksnes kauplemiskoha turupoole aruanne tuleb esitada vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklis 3 ja tabelis 2 sätestatud detailsusnõuetele, seega peavad X ja Y aruanded olema üksnes sekundi täpsusega (ehkki aruanded võib esitada ka suurema detailsusega), investeerimisühing Y võib aruandesse märkida talle investeerimisühingu Z poolt kinnitatud sooritamise aja ja ühing X võib aruandesse märkida talle investeerimisühingu Y poolt kinnitatud aja.

See aruandlus on peaaegu sama kui ahela korral, kus investeerimisühingud tegutsevad kliendikorralduste sobitamise teel, v.a korralduse indikaatori edastamise väli, kuhu edastamise nõuetele mittevastavate ühingute puhul märgitakse 'true', kuid kliendikorralduste sobitamise teel tegutsevate investeerimisühingute korral 'false', sest nad ei edasta.

Olenemata sellest, kas instrument on tuletisinstrument või mitte, märgitakse investeerimisühingute X ja Y aruannetes väljale 36 'XOFF', sest need aruanded ei seondu otseselt tehingu sooritamisega kauplemiskohas.

5.26.2.3 Ahelad, milles osa ühinguid ei kuulu MiFIRi kohaldamisalasse

5.26.2.3.1 Korralduse saatmine ühingule, kellel puudub aruandluskohustus

67. näide

Investeerimisühing X teeb kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel investeerimisotsuse osta kliendile A aruandluskohustuse alla kuuluv finantsinstrument. Kaupleja 1 teeb investeerimisotsuse ja kaupleja 2 otsustas saata korralduse täitmiseks ühingu X sidusettevõtjale, ühingule G. Investeerimisühing X kaupleb „muu volituse alusel". Ühing G on eraldi juriidiline isik, mis asub USAs ja mille LEI on GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn>
7	Ostja tunnuskood	Kliendi A {LEI}	
12	Ostja otsustaja kood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Ühingu G {LEI}	
21	Müüja otsustaja kood		
25	Korralduse indikaatori edastamine	'true'	
36	Koht	'XOFF'	
57	Ühingusisene investeerimisotsus	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}	

			<Tx> … <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> … <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> … </New> </Tx>

Investeerimisühing X ei pea vaatama oma vahetust vastaspoolest kaugemale, seega märgib ta aruandes müüjaks oma USA sidusettevõtja, ühingu G.

Väljale 59 märgitakse kaupleja 2 kliendi riiklik tunnus, sest kaupleja 2 tegi otsuse esitada korraldus ühingule G.

Ühing G aruandeid ei esita, sest ei ole investeerimisühing.

5.26.2.3.2 Korralduse saamine ühingult, kellel puudub aruandluskohustus

68. näide

Ühing H on USA investeerimisjuht, kelle LEI on HHHHHHHHHHHHHHHHHHHH ja kes teeb kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel investeerimisotsuse osta aruandluskohustuse alla kuuluv instrument oma kliendile A. Ühing edastab korralduse täitmiseks oma sidusettevõtjale, investeerimisühingule X. Investeerimisühingu X nimel tegutsev kaupleja 1 täidab tehingukorralduse investeerimisühinguga Z.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML

4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>HHHHHHHHHHHHHHHHHHHH</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> … <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> … <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>
7	Ostja tunnuskood	Ühingu H {LEI}	
12	Ostja otsustaja kood		
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	
21	Müüja otsustaja kood		
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	
36	Koht	‘XOFF’	
57	Ühingusisene investeerimisotsus		
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	

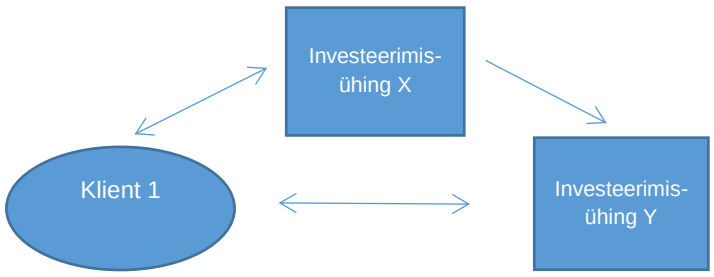
Investeerimisühing X ei pea vaatama oma vahetust kliendist kaugemale ja ühing H ei saa edastada vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 tingimustele, sest ei ole investeerimisühing, seega peaks investeerimisühing X märkima aruandes ostjaks USA sidusettevõtja, ühingu H.

Ühing H aruandeid ei esita, sest ei ole investeerimisühing.

5.26.2.4 Investeerimisühing X ja tema klient tegutsevad kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel ja on mõlemad sooritava investeerimisühingu Y kliendid.

69. näide

Et komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 kohast edastamist ei ole toimunud, peab korralduse vastuvõtjaks olev investeerimisühing siis, kui investeeringuvalitseja tegutseb kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel, märkima aruandes ostjaks/müüjaks kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel tegutseva isiku. See on nii ka siis, kui investeeringuvalitseja on samuti vastuvõtva investeerimisühingu klient ning olenemata sellest, kas kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel tegutsev investeeringuvalitseja on investeerimisühing või ühing.



Klient 1 on investeerimisühingu Y klient ja ka investeerimisühingu X klient.

Investeerimisühingul X on kliendi 1 kaalutlusõigusel põhinev volitus ning ta otsustab osta kliendile 1 mõningaid finantsinstrumente ja saadab korralduse investeerimisühingule Y.

Investeerimisühing X ei vasta komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimustele.

Kuidas peab investeerimisühing X täitma aruandes ostja/müüja välja?

Investeerimisühing Y peaks aruandes ostjaks märkima investeerimisühingu X, mitte kliendi 1.

5.26.3 Ahelad, milles kõik investeerimisühingud vastavad komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 tingimustele

Edastav investeerimisühing peab esitama üksnes komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud teabe ja üksnes antud korraldusega seonduvas ulatuses. Näiteks ELi-välisel organiseeritud kauplemisplatvormil kaubeldava finantsinstrumendi korral, mille aluseks oleva finantsinstrumendiga kaubeldakse kauplemiskohas, millel ISIN-kood puudub, ei esita edastav investeerimisühing ISIN-koodi, sest see puudub ja seetõttu see korraldusega ei seondu. Samuti, ehkki edastav investeerimisühing esitaks ise tehinguaruannet esitades väljadel 42–56 oleva teabe, ei pea ta

seda teavet esitama vastuvõtvale investeerimisühingule[30] esitatavate tehinguandmete hulgas. Kogu muu teabe, mille vastuvõttev investeerimisühing peab tehinguaruandes esitama, koostab vastuvõttev investeerimisühing oma andmetest tegelike soorituste põhjal. Vastuvõttev investeerimisühing peaks aruandes nende komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa väljade täitmisel kasutama üksnes edastavalt investeerimisühingult saadud teavet.

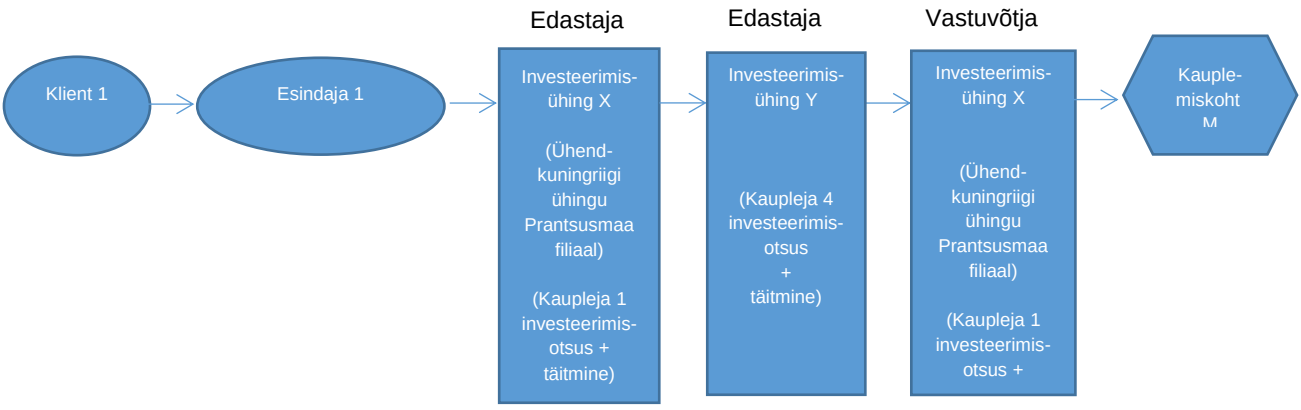
Edastava investeerimisühingu esitatav hind ja kogus on korralduse hind ja kogus ning tehingu tegelikku hinda ja kogust ei pea edastav investeerimisühing kinnitama, v.a kui toimub jaotamine mitmele kliendile, mis juhul peab edastav investeerimisühing esitama igale kliendile jaotatava koguse.

Ostja(te)/müüja(te) identifitseerimine vastuvõtva investeerimisühingu aruandes sõltub üksnes sellest, kas edastamise tingimused on täidetud. Seega kui korralduse ajal esitatakse teave klientide vahel jaotamis(t)e kohta, näiteks seoses kliiringu ja arveldustega, kuid edastamise kokkulepe puudub või mõni edastamise tingimustest on täitmata, märgib vastuvõttev investeerimisühing ostjaks/müüjaks korralduse saatnud investeerimisühingu.

Kui väljad, mis tuleks täita edastava investeerimisühingu teabega (rohelise taustaga), on alljärgnevates näidetes tühjad, tähendab see, et edastav investeerimisühing on edastanud need tühjana (st neid välju ei kohaldata).

Alljärgnevates näidetes on selgitatud, mis teavet peab edastav investeerimisühing esitama vastuvõtvale investeerimisühingule, ning näidatud, mis osa sellest teabest peab vastuvõttev investeerimisühing aruandes esitama edastatud teabe järgi, mitte oma teabe järgi, ja kuidas seda märkida aruannetesse. Samuti on näidatud, et edastava ühingu identifitseerimiskoodiga tuleb ostja/müüja väljale märkida algne edastaja, mitte edastav investeerimisühing, kes vastuvõtvale investeerimisühingule tegelikult teabe esitas.

70. näide



Klient 1 on investeerimisühingu X klient. Kliendi 1 volituse alusel tegutsev isik, esindaja 1, otsustab müüa kliendile 1 kuuluvad 523 kaubatuletisinstrumenti hinnaga vähemalt 31 eurot ja annab vastava käsundi investeerimisühingu X Prantsusmaa filiaalile. Kaupleja 1, kelle üle teeb järelevalvet ühingu X Ühendkuningriigi peakontor, võtab korralduse esindajalt 1 vastu ja annab käsundi investeerimisühingule Y. Kaupleja 4 otsustab investeerimisühingu X korralduse vastu võtta ja saadab korralduse investeerimisühingule Z. Investeerimisühing Z on Ühendkuningriigi ühing. Kaupleja 5

[30] Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 4 lõike 2 punkti a kohaselt peab finantsinstrumendi tähistama üksnes tunnuskoodiga.

otsustab investeerimisühingu Y korralduse vastu võtta ja kaupleja 6 saadab korralduse kauplemiskohta M.

Korraldus täidetakse kauplemiskoha M tellimusraamatus osaliselt 1. juulil 2018 kell 13.40.23,4672, mil müüakse 500 finantsinstrumenti hinnaga 32,50 eurot. Kauplemiskoht määrab tehingule tunnuskoodi '1234'.

Kaubatuletisinstrumendi ISIN on XX000000001.

Klient 1 vähendab oma riski objektiivselt mõõdetavalt vastavalt direktiivi 2014/65/EL artiklile 57.

Investeerimisühingud X ja Y vastavad mõlemad edastamise tingimustele.

Investeerimisühing X peaks esitama investeerimisühingule Y järgmise teabe:

1) Finantsinstrumendi tunnuskood: finantsinstrumendi ISIN (XX000000001)

2) Teave, et korraldus on tehtud finantsinstrumendi võõrandamiseks

3) Korralduse hind ja kogus (523 finantsinstrumenti hinnaga vähemalt 31 eurot)

4) Müüja teave: kliendi 1 riiklik klienditunnus

5) Kliendi 1 andmed:

   a) ees- ja perekonnanimi;
   b) sünnikuupäev

6) Otsustaja teave ja andmed: esindaja 1 riiklik klienditunnus, esindaja 1 ees- ja perekonnanimi ning sünnikuupäev

7) Edastavas ühingus (investeerimisühing X) investeerimisotsuse eest vastutava isiku või algoritmi teave: tühi (sest investeerimisotsus tehti väljaspool ühingut – otsuse tegi esindaja 1)

8) Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik: tühi

9) Kliendilt korralduse saanud investeerimisühingu X filiaali riik: FR

10) Kaubatuletisinstrumendi indikaator: true

11) Edastava investeerimisühingu tunnuskood: investeerimisühingu X LEI

Et ka investeerimisühing Y edastab, peaks ta esitama investeerimisühingule Z sama teabe, mille esitas talle investeerimisühing X, sealhulgas edastava investeerimisühingu tunnuskoodi, mis praegusel juhul on investeerimisühingu X LEI.

Väljale 27 tuleks märkida investeerimisühing X, sest investeerimisühing X on teabe edastanud ning see teave edastatakse investeerimisühingu Y kaudu investeerimisühingule Z.

Punktide 1 ja 4–10 teave on täpselt sama, mille esitaks aruandes investeerimisühing X, kui ta ei vastaks edastamise tingimustele ja esitaks tehinguaruande ise.

Alljärgnevates näidetes täidetakse investeerimisühingu Y aruandes rohelise taustaga väljad otse edastava investeerimisühingu ehk investeerimisühingu Y esitatud teabega.

Et investeerimisühingud X ja Y vastavad mõlemad edastamise tingimustele, ei peaks nad esitama tehinguaruannet.

5.26.3.1 Vastuvõttev investeerimisühing kaupleb oma arvel

Investeerimisühingu Z aruanne peaks olema järgmine:

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’	
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu Z {LEI}	Investeerimisühingu Z {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu Z {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Z {LEI}	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
17	Ostjat esindava filiaali riik		‘FR’
18	Müüja – eesnimi (-nimed)		‘JEAN’
19	Müüja – perekonnanimi (-nimed)		‘COCTEAU’
20	Müüja – sünniaeg		1962-06-04
21	Müüja otsustaja kood		Esindaja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
22	Müüja otsustaja – eesnimi (-nimed)		‘FABIO’
23	Müüja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)		‘LUCA’
24	Müüja otsustaja – sünniaeg		‘1962-10-11’
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood		
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood		Investeerimisühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-01T13:40:23.467Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘500’	‘500’
33	Hind	‘32.5’	‘32.5’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	Instrumendi {ISIN}

57	Ühingusisene investeerimisotsus	Kaupleja 5 {RIIKLIK_TUNNUS}	
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik	‘GB’	
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 6 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 6 {RIIKLIK_TUNNUS}
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	‘GB’	‘GB’
64	Kaubatuletisinstrumendi indikaator	‘false’	‘true’

XML:

1. aruanne (turupool)	2. aruanne (kliendipool)
<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm> <BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr>

```
      <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
    </Tx>
    <FinInstrm>
      <Id>XX000000001</Id>
    </FinInstrm>
    <InvstmtDcsnPrsn>
      <Prsn>
        <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch>
        <Othr>
          <Id>FI1234567890A</Id>
          <SchmeNm>
            <Cd>NIDN</Cd>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </InvstmtDcsnPrsn>
    <ExctgPrsn>
      <Prsn>
        <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch>
        <Othr>
          <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id>
          <SchmeNm>
            <Prtry>CONCAT</Prtry>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </ExctgPrsn>
    <AddtlAttrbts>
    ...
      <RskRdcgTx>false</RskRdcgTx>
    ...
    </AddtlAttrbts>
  </New>
</Tx>
```

```
          <Id>ITABCDEF1234567890</Id>
          <SchmeNm>
            <Cd>NIDN</Cd>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </DcsnMakr>
  </Sellr>
  <OrdrTrnsmssn>
    <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>
<TrnsmttgSellr>12345678901234567890</Tr
nsmttgSellr>
  </OrdrTrnsmssn>
  <Tx>
    <TradDt>2018-07-
01T13:40:23Z</TradDt>
    <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
    <Qty>
      <Unit>500</Unit>
    </Qty>
    <Pric>
      <Pric>
        <MntryVal>
          <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
        </MntryVal>
      </Pric>
    </Pric>
    <TradVn>XOFF</TradVn>
  </Tx>
  <FinInstrm>
    <Id>XX000000001</Id>
  </FinInstrm>
  <ExctgPrsn>
    <Prsn>
      <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch>
      <Othr>

<Id>HU19800413ADAM#JONES</Id>
        <SchmeNm>
          <Prtry>CONCAT</Prtry>
            </SchmeNm>
      </Othr>
    </Prsn>
  </ExctgPrsn>
  <AddtlAttrbts>
    <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx>
    …
  </AddtlAttrbts>
 </New>
</Tx>
```

Väli 57: et investeerimisühing Z kaupleb oma arvel, on investeerimisotsuse tegijaks tema ning turupoole aruande väljale 57 tuleks märkida investeerimisühingus Z otsuse teinud isik (kaupleja 5). Kliendipoole aruanne täidetakse edastavalt investeerimisühingult saadud teabega. Siin näites peaks see olema tühi, sest investeerimisühing X jättis välja tühjaks (otsuse tegi esindaja 1).

Väli 58: ehkki korraldus saabus filiaalilt, tegi otsuse klient (või tema esindaja), mistõttu see väli on kliendipoole aruandes tühi.

Aeg ja hind peaksid olema samad (kui erinevatest ajalise detailsuse nõuetest ei tulene teisiti), ent kliendipoole aruande aeg võib olla hilisem (aeg, mil omand läks kliendile üle). Mikrosekundi detailsusega tuleb teatada üksnes investeerimisühingu Z turupoole aruanne. Kliendipoole aruanne tuleb teatada sekundi täpsusega (kuid investeerimisühing Z võib teatada ka suurema ajalise detailsusega).

5.26.3.2 Vastuvõttev ühing tegutseb „kliendikorralduste sobitamise teel / muu volituse alusel“

71. näide

Kui vastuvõttev investeerimisühing, ühing Z, tegutseb kliendikorralduste sobitamise teel, peaks ta esitama aruande järgmiselt:

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’	<Tx> <New> ... <ExctgPty>8888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <Prsn> <FrstNm>FABIO</FrstNm> <Nm>LUCA</Nm>
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	
7	Ostja tunnuskood	Kauplemis-koha M keskse vastaspoole {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	
17	Ostjat esindava filiaali riik	‘FR’	
18	Müüja – eesnimi (-nimed)	‘JEAN’	
19	Müüja – perekonnanimi (-nimed)	‘COCTEAU’	
20	Müüja – sünniaeg	‘1962-06-04’	
21	Müüja otsustaja kood	Esindaja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	
22	Müüja otsustaja – eesnimi (-nimed)	‘FABIO’	
23	Müüja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)	‘LUCA’	
24	Müüja otsustaja – sünniaeg	‘1974-10-11’	
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood		
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	

28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-01T13:40:23.467Z’	<BirthDt>1962-10-11</BirthDt> <Othr> <Id>ITABCDEF1234567890</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> <FinInstrm> <Id>XX000000001</Id> </FinInstrm> <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>HU19800413ADAM#JONES</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>true</RskRdcgTx> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>
29	Kauplemisvolitused	‘MTCH’	
30	Kogus	‘500’	
33	Hind	‘32.5’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
36	Koht	Kauplemis-koha M segmendi {MIC}	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	
57	Ühingusisene investeerimisotsus		
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik		
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 6 {RIIKLIK_TUNNUS}	
64	Kaubatuletisinstrumendi indikaator	‘true’	

Kui investeerimisühing Z tegutseb „muu volituse alusel“, on tehinguaruanne eespool toodud aruandega identne, kuid väljale 29 märgitakse kauplemisvolitusena ‘AOTC’.

5.26.3.3 Kliendil on tehinguaruandluse kohustus

72. näide

Eeldame, et kliendi 1 asemel on kliendiks klient A, kes on investeerimisühing. Klient A peaks aruandes esitama hinna ja aja, mille on talle kinnitanud investeerimisühing X. Eeldusel, et investeerimisühing Z kaupleb „muu volituse alusel“ või „kliendikorralduste sobitamise teel“, esitab klient A tehinguaruandes sama hinna ja aja kui investeerimisühingu Z aruandes, v.a punktis 7.2 sätestatud detailsusnõuetest tulenevad erisused, sest investeerimisühingud X, Y ja Z kauplevad kõik „muu volituse alusel“ ning seega on tegu ühe ja sama tehinguga. Kui investeerimisühing Z tegutseb oma arvel, võivad hind ja aeg erineda. Klient A peaks ostjaks märkima investeerimisühingu X, sest klient A kauples temaga.

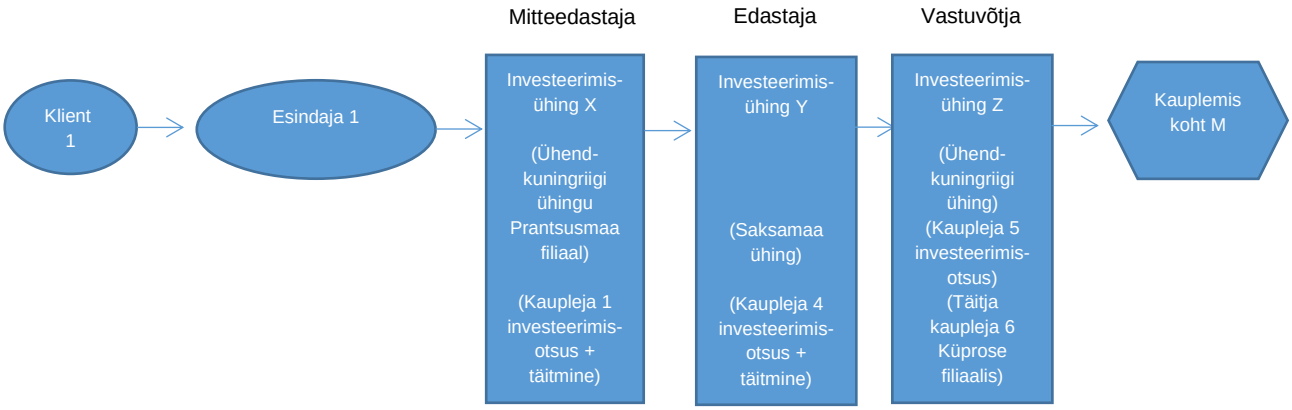
Investeerimisühingu Z aruanded peaksid olema samad kui punkti 5.26.3.2 näidetes (olenevalt kauplemisvolitusest), kuid kliendi A tunnuseks peaks märkima kliendi A LEI ning kaubatuletisinstrumendi indikaator peaks olema ‘false’.

5.26.4 Ahelad, kus komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud tingimused on mõne ahelas osaleva investeerimisühingu korral täidetud

Alljärgnev näide selgitab, et edastav investeerimisühing peab märkima, kas algne edastav investeerimisühing on tema või muu isik.

5.26.4.1 Lõppkliendiga kauplev investeerimisühing ei vasta edastamise tingimustele

73. näide



Klient 1 on investeerimisühingu X klient. Kliendi 1 volituse alusel tegutsev isik, esindaja 1, otsustab müüa kliendile 1 kuuluvaid aktsiaid ja annab vastava käsundi investeerimisühingu X Prantsusmaa filiaalile. Kaupleja 1, kelle üle teeb järelevalvet Ühendkuningriigi peakontor, otsustab korralduse esindajalt 1 vastu võtta ja saadab korralduse investeerimisühingule Y, kes on Saksamaa ühing. Kaupleja 4 otsustab investeerimisühingu Y korralduse vastu võtta ja saadab selle investeerimisühingule Z. Kaupleja 5 otsustab korralduse investeerimisühingult Y vastu võtta ja investeerimisühingu Z Küprose filiaali järelevalve alla kuuluv kaupleja 6 saadab korralduse

kauplemiskohta M. Investeerimisühing X ja ühing Y kauplevad „muu volituse alusel“ ning investeerimisühing Z kaupleb oma arvel.

Korralduse täidab kauplemiskoha M tellimusraamatus investeerimisühing Z 1. juulil 2018 kell 13.40.23,4672 hinnaga 32,50 eurot. Kauplemiskoht määrab tehingule tunnuskoodi ‘1234’. Investeerimisühing X otsustab andmeid investeerimisühingule Y mitte edastada.

Investeerimisühing Y edastab investeerimisühingule Z oma kliendi (investeerimisühingu X) andmed ja muu nõutava teabe ning täidab ka muud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimused.

Investeerimisühing Y on Saksamaa ühing.

Klient 1 müüb lühikeseks.

Tehing toimub aktsiaga, mille ISIN on XX000000002.

Investeerimisühing Y peaks esitama investeerimisühingule Z järgmised andmed:

1) Finantsinstrumendi tunnuskood: instrumendi ISIN (XX000000002)

2) Teave, et korraldus on tehtud finantsinstrumendi võõrandamiseks

3) Korralduse hind ja kogus

4) Ostja teave: investeerimisühingu X LEI. Põhjus on, et investeerimisühing X ei ole oma kliendi (klient 1) andmeid investeerimisühingule Y edastanud. Seetõttu käsitab investeerimisühing Y müüjana investeerimisühingut X, mitte klienti 1.

5) Otsustaja teave ja andmed: tühi

6) Lühikeseks müügi indikaator: SELL (investeerimisühing X ei müü lühikeseks)

7) Edastavas ühingus investeerimisotsuse eest vastutava isiku või algoritmi identifitseerimisandmed: tühi (sest otsus tehti väljaspool ühingut)

8) Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik: tühi (sest otsus tehti väljaspool investeerimisühingut Y)

9) Kliendilt korralduse saanud investeerimisühingu Y filiaali riik: DE (et filiaale ei osalenud, märgitakse siia ühingu peakontori riigi kahetäheline kood, praegusel juhul ‘DE’, sest tegu on Saksamaa ühinguga)

10) Edastava investeerimisühingu tunnuskood: investeerimisühingu Y LEI.

Et investeerimisühing X ei vasta edastamise tingimustele, peaks ta saatma oma tehinguaruande.

Et investeerimisühing Y vastab edastamise tingimustele, ei peaks ta saatma oma tehinguaruannet.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Z aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu Z 1. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Z 2. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’		
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
17	Ostjat esindava filiaali riik		‘DE’	‘FR’
18	Müüja – eesnimi (-nimed)			‘JEAN’
19	Müüja – perekonnanimi (-nimed)			‘COCTEAU’
20	Müüja – sünniaeg			‘1962-06-04’
21	Müüja otsustaja kood			Esindaja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
22	Müüja otsustaja – eesnimi (-nimed)			‘FABIO’
23	Müüja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)			‘LUCA’
24	Müüja otsustaja – sünniaeg			‘1974-10-11’
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’	‘true’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood			
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood		Investeerimis-ühingu Y {LEI}	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-01T13:40:23.467Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘AOTC’
33	Hind	‘32.5’	‘32.5’	‘32.5’

34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	XOFF	XOFF
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	Instrumendi {ISIN}	Instrumendi {ISIN}
57	Ühingusisene investeerimisotsus	Kaupleja 5 {RIIKLIK_TUNNUS}		
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik	‘GB’		
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 6 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 6 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	‘CY’	‘CY’	‘GB’
62	Lühikeseks müügi indikaator	‘SELL’	‘SELL’	‘SESH’

XML:

Investeerimisühingu Z 1. aruanne Turupool	**Investeerimisühingu Z 2. aruanne Kliendipool**	**Investeerimisühingu X 1. aruanne**
<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn>	<Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn>

```
        </OrdrTrnsmssn>
        <Tx>
          <TradDt>2018-07-
01T13:40:23.467Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgC
pcty>
          <Pric>
            <Pric>
              <MntryVal>
                <Amt
Ccy="EUR">32.5</Amt>
              </MntryVal>
            </Pric>
          </Pric>

<TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>1234</Tra
dPlcMtchgId>
        </Tx>
        <FinInstrm>
          <Id>XX000000002</Id>
        </FinInstrm>
        <InvstmtDcsnPrsn>
          <Prsn>

<CtryOfBrnch>GB</CtryOfBr
nch>
            <Othr>
 <Id>FI1234567890A</Id>

            <SchmeNm>
              <Cd>NIDN</Cd>
            </SchmeNm>
          </Othr>
        </Prsn>
</InvstmtDcsnPrsn>
        <ExctgPrsn>
          <Prsn>

<CtryOfBrnch>CY</CtryOfBr
nch>
            <Othr>

<Id>HU19800413ADAM#JO
NES</Id>
            </Othr>
            <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
</SchmeNm>
          </Prsn>
        </ExctgPrsn>
        <AddtlAttrbts>

<ShrtSellgInd>SELL</ShrtSel
lgInd>
```

```
<TrnsmssnInd>false</Trnsmss
nInd>

<TrnsmttgSellr>ABCDEFGHIJK
LMNOPQRST</TrnsmttgSellr>
        </OrdrTrnsmssn>
        <Tx>
          <TradDt>2018-07-
01T13:40:23Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgCpc
ty>
          <Pric>
            <Pric>
              <MntryVal>
                <Amt
Ccy="EUR">32.5</Amt>
              </MntryVal>
            </Pric>
          </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
        </Tx>
        <FinInstrm>
          <Id>XX000000002</Id>
</FinInstrm>
        <ExctgPrsn>
          <Prsn>

<CtryOfBrnch>CY</CtryOfBrnc
h>
            <Othr>

<Id>HU19800413ADAM#JONE
S</Id>
            </Othr>
            <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
</SchmeNm>
          </Prsn>
        </ExctgPrsn>
        <AddtlAttrbts>
        ...

<ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellg
Ind>
          ...
        </AddtlAttrbts>
      </New>
    </Tx>
```

```
</Id>


<CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnc
h>
          </AcctOwnr>
          <DcsnMakr>
            <Prsn>

<FrstNm>FABIO</FrstNm>
              <Nm>LUCA</Nm>
              <BirthDt>1962-10-
11</BirthDt>
              <Othr>

<Id>ITABCDEF1234567890</Id
>
                <SchmeNm>
                  <Cd>NIDN</Cd>
                </SchmeNm>
              </Othr>
            </Prsn>
          </DcsnMakr>
        </Sellr>
        <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnI
nd>
        </OrdrTrnsmssn>
        <Tx>
          <TradDt>2018-07-
01T13:40:23Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCp
cty>
          <Pric>
            <Pric>
              <MntryVal>
                <Amt
Ccy="EUR">32.5</Amt>
              </MntryVal>
            </Pric>
          </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
        </Tx>
        <FinInstrm>
          <Id>XX000000002</Id>
</FinInstrm>
        <ExctgPrsn>
          <Prsn>

<CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnc
h>
            <Othr>
```

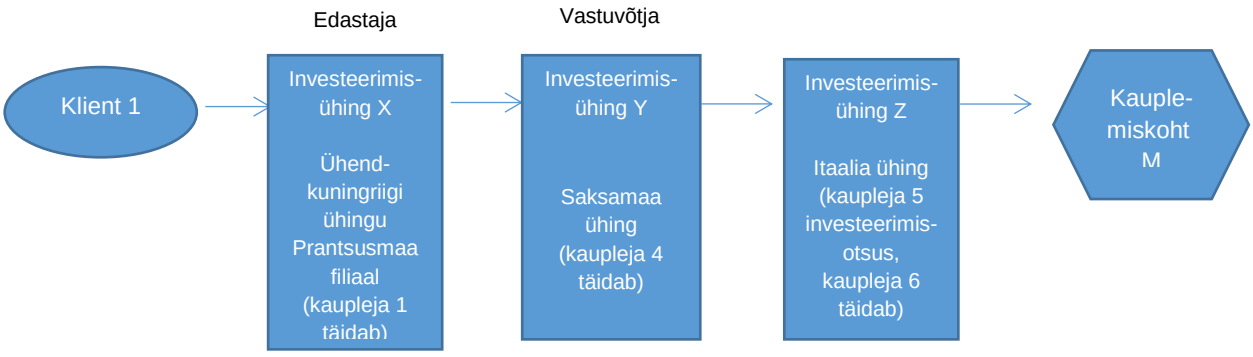
… </AddtlAttrbts> </New> </Tx>		<Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Investeerimisühingu Z tehinguaruannetes on „müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood“ (väli 27) investeerimisühingu Y, mitte investeerimisühingu X oma (investeerimisüihing X ei ole edastaja), sest investeerimisüihing Y on investeerimisühingule Z teatanud, et on korralduse, mille ta investeerimisühingule Z saatis, edastanud investeerimisühingu X nimel.

2. aruande (kliendipoole aruanne) väljadele 57 ja 58 märgitakse teave, mille esitas investeerimisühingule Z investeerimisüihing Y, kes esitab aruande. Mõlemad väljad on tühjad, sest otsuse tegi klient. Seevastu väljadele 59 ja 60 tuleb märkida investeerimisühingu Z enda andmed, mistõttu sinna märgitakse kaupleja 6, kes tegutseb investeerimisühingu Z Küprose filiaali järelevalve all.[31]

5.26.4.2 Investeerimisüihing, kes tegutseb vastuvõtva ühingu ja edastava ühinguna, kuid ei vasta edastamise tingimustele

74. näide



Klient 1 on investeerimisühingu X klient. Kliendi kaalutlusõigusel põhineva volituse alusel tegutseva investeerimisühingu X Prantsusmaa filiaalis asuv kaupleja 1 annab investeerimisühingule Y, kes on Saksamaa ühing, korralduse müüa finantsinstrumente. Kaupleja 1 kuulub investeerimisühingu X

[31] Seejuures tuleb siis, kui otsuse tegi klient, märkida sinna ‘NORE’ (vt punkt 5.12).

Ühendkuningriigi peakontori järelevalve alla. Kaupleja 4 otsustab korralduse ühingult X vastu võtta ja saadab korralduse ühingule Z. Itaalia ühingu, investeerimisühingu Z nimel tegutsev kaupleja 5 otsustab korralduse investeerimisühingult Y vastu võtta ja kaupleja 6 saadab korralduse kauplemiskohta M.

Seejärel täidab korralduse kauplemiskoha M tellimusraamatus investeerimisühing Z 1. juulil 2018 kell 13.40.23,4672 hinnaga 32,50 eurot. Kauplemiskoht määrab tehingule tunnuskoodi '1234'.

Investeerimisühing X edastab investeerimisühingule kliendi 1 andmed ja muu teabe, nagu näidatud allpool, ning täidab ka muud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimused.

Investeerimisühing X otsustab andmeid investeerimisühingule Y mitte edastada. Investeerimisühing Z kaupleb oma arvel.

Tehing tehakse kaubatuletisinstrumendiga, mille ISIN on XX000000003, ning klient 1 ei vähenda oma riski objektiivselt mõõdetavalt vastavalt direktiivi 2014/65/EL artiklile 57.

Investeerimisühing X peaks esitama investeerimisühingule Y järgmise teabe.

1) Instrumendi tunnuskood: instrumendi ISIN (XX000000003)
2) Teave, et korraldus on tehtud finantsinstrumendi võõrandamiseks
3) Korralduse hind ja kogus
4) Müüja teave: kliendi 1 riiklik klienditunnus:
5) Kliendi 1 andmed:
   a) eesnimi (-nimed) ja perekonnanimi (-nimed)
   b) sünnikuupäev;
6) Otsustaja teave ja andmed: investeerimisühingu X LEI
7) Edastavas ühingus (investeerimisühing X) investeerimisotsuse eest vastutava isiku või algoritmi identifitseerimisandmed: kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
8) Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik: GB
9) Kliendilt korralduse saanud investeerimisühingu X filiaali riik: FR
10) Edastava ühingu tunnuskood: investeerimisühingu X LEI
11) Kaubatuletisinstrumendi indikaator: false

Et investeerimisühing Y ei edasta kõiki andmeid, peaks ta saatma oma tehinguaruande.
Et investeerimisühing X vastab komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimustele, ei peaks ta esitama tehinguaruannet.

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu Z 1. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Z 2. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Y 1. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	'1234'		
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimisühingu Z {LEI}

16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Z {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
17	Ostjat esindava filiaali riik		‘IT’	‘FR’
18	Müüja – eesnimi (-nimed)			‘JEAN’
19	Müüja – perekonnanimi (-nimed)			‘COCTEAU’
20	Müüja – sünniaeg			‘1962-06-04’
21	Müüja otsustaja kood			Investeerimisühingu X {LEI}
22	Müüja otsustaja – eesnimi (-nimed)			
23	Müüja otsustaja – perekonnanimi (-nimed)			
24	Müüja otsustaja – sünniaeg			
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’	‘true’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood			
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood			Investeerimisühingu X LEI
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-07-01T13:40:23.467Z’	‘2018-07-01T13:40:23.467Z’	‘2018-07-01T13:40:23Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘AOTC’
33	Hind	‘32.5’	‘32.5’	‘32.5’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	Instrumendi {ISIN}	Instrumendi {ISIN}
57	Ühingusisene investeerimisotsus	Kaupleja 5 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 5 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik	‘IT’	‘IT’	‘GB’
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 6 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 6 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}

60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	‘IT’	‘IT’	‘DE’
64	Kaubatuletis-instrumendi indikaator	‘false’	‘false’	‘false’

XML:

Investeerimisühingu Z 1. aruanne Turupool	**Investeerimisühingu Z 2. aruanne Kliendipool**	**Investeerimisühingu Y 1. aruanne**
<Tx> <New> <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric>	<Tx> <New> <ExctgPty>88888888888888888888</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-07-01T13:40:23.467Z</TradDt> <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> … <Pric> <Pric> <MntryVal>	<Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Id> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Id> </Prsn> <CtryOfBrnch>FR</CtryOfBrnch> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn>

```
        </Pric>

<TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
      </Tx>
      <FinInstrm>
        <Id>XX000000003</Id>
      </FinInstrm>
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>

<CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch>
          <Othr>

<Id>FI1234567890A</Id>
            <SchmeNm>
              <Cd>NIDN</Cd>
            </SchmeNm>

          </Othr>
        </Prsn>
      </InvstmtDcsnPrsn>
      <ExctgPrsn>
        <Prsn>
<CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch>
          <Othr>

<Id>HU19800413ADAM#JONES</Id>
          </Othr>
          <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
</SchmeNm>

        </Prsn>
      </ExctgPrsn>
      <AddtlAttrbts>

<RskRdcgTx>false</RskRdcgTx>
        …
      </AddtlAttrbts>
    </New>
  </Tx>
```

```
            <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
          </MntryVal>
        </Pric>
      </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      <FinInstrm>
        <Id>XX000000003</Id>
      </FinInstrm>
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>

<CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch>
          <Othr>

<Id>FI1234567890A</Id>
            <SchmeNm>
<Cd>NIDN</Cd>
</SchmeNm>

          </Othr>
        </Prsn>
      </InvstmtDcsnPrsn>
      <ExctgPrsn>
        <Prsn>

<CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch>
          <Othr>

<Id>HU19800413ADAM#JONES</Id>
          </Othr>
          <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
</SchmeNm>

        </Prsn>
      </ExctgPrsn>
      <AddtlAttrbts>

<RskRdcgTx>false</RskRdcgTx>
        …
      </AddtlAttrbts>
    </New>
  </Tx>
```

```
<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd>

<TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-07-01T13:40:23Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        …
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      <FinInstrm>
        <Id>XX000000003</Id>
      </FinInstrm>
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>

<CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch>
          <Othr>

<Id>CA1112223334445555</Id>
          </Othr>
          <SchmeNm>
            <Cd>CCPT</Cd>
          </SchmeNm>

        </Prsn>
      </InvstmtDcsnPrsn>
      <ExctgPrsn>
        <Prsn>

<CtryOfBrnch>DE</CtryOfBrnch>
          <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAIR</Id>
    <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
    </SchmeNm>
```

		</Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <RskRdcgTx>false</RskRdcgTx> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Investeerimisühing Y tegutseb nii vastuvõtva investeerimisühinguna (võtab vastu teabe investeerimisühingult X, kui edastamise tingimused on täidetud) kui ka edastava investeerimisühinguna, kes ei vasta edastamise tingimustele. Seega peab investeerimisühing Y esitama tehinguaruande. Investeerimisühing Y peaks täitma välja 25, märkides sinna, et ta edastab, ent ei vasta edastamise tingimustele, ning välja 27, märkides sinna, et on saanud teabe investeerimisühingult X, kes on investeerimisühingule Y edastamisel täitnud edastamise tingimused. Lisaks märgitakse väljale 17 investeerimisühingult X saadud teave, mistõttu sinna tuleks märkida edastava, mitte vastuvõtva investeerimisühingu filiaal.

5.26.4.3 Ühing koondab korraldusi ja vastab mõningate, ent mitte kõigi korralduste puhul edastamise tingimustele

75. näide

Investeerimisühingu X kaks klienti, klient A ja klient B, esitavad vastavalt 100 ja 200 instrumendi müügikorraldused.

Investeerimisühing X edastab korraldused investeerimisühingule Y. Investeerimisühing X täidab komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimused üksnes kliendi A korralduse puhul. Investeerimisühing Y täidab koondkorralduse 300 ühikule hinnaga 25,54 eurot 28. oktoobril 2018 kell 11.23.45,1243 kauplemiskohas M. Investeerimisühing X ja ühing Y kauplevad „muu volituse alusel“.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	<Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id>
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kliendi B {LEI}	
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘true’	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-10-28T11:23:45Z’	
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	
30	Kogus	‘200’	
33	Hind	‘25.54’	

36	Koht	‘XOFF’	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-10-28T11:23:45Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">25.54</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> … </New> </Tx>

Mis peab olema investeerimisühingu Y aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	‘INTC’	‘INTC’
16	Müüja tunnuskood	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’	‘false’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood			
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood		Investeerimis-ühingu X {LEI}	
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-10-28T11:23:45.124Z’	‘2018-10-28T11:23:45.124Z’	‘2018-10-28T11:23:45.124Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘300’	‘100’	‘200’
33	Hind	‘25.54’	‘25.54’	‘25.54’

36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

1. aruanne

```
<Tx>
    <New>

<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM
NOPQRST</ExctgPty>
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>11111111111111111111
</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>false</Trnsmss
nInd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-10-
28T11:23:45.124Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCp
cty>
        <Qty>
          <Unit>300</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">25.54</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XMIC</TradVn>
      </Tx>
      …
    </New>
  </Tx>
```

2. aruanne

```
<Tx>
    <New>

<ExctgPty>ABCDEFGHIJKLM
NOPQRST</ExctgPty>
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAA
AA</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>false</Trnsmss
nInd>

<TrnsmttgSellr>123456789012
34567890</TrnsmttgSellr>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-10-
28T11:23:45.124Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCp
cty>
        <Qty>
          <Unit>100</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">25.54</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      …
```

3. aruanne

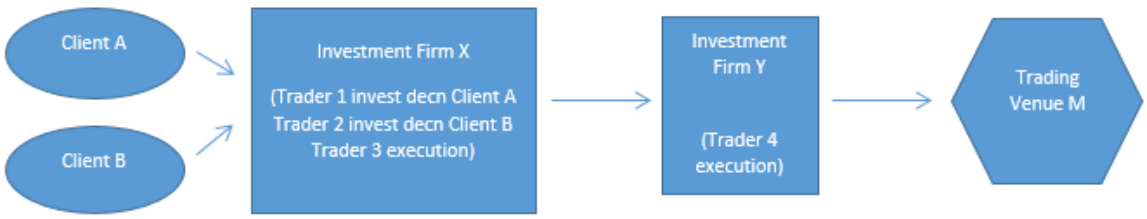
```
<Tx>
    <New>

<ExctgPty>ABCDEFGHIJKL
MNOPQRST</ExctgPty>
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>12345678901234567890
</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>false</Trnsms
snInd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-10-
28T11:23:45.124Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</Tradg
Cpcty>
        <Qty>
          <Unit>200</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">25.54</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>
    <TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      …
    </New>
```

	</New> </Tx>	

5.27 Investeerimisühing tegutseb mitme kliendi kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel

5.27.1 Investeerimisühing tegutseb mitme kliendi kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel, kuid ei vasta edastamise tingimustele (koondkorralduste ja ahelate/edastamise kombinatsioon)

76. näide



Client A	Klient A
Client B	Klient B
Investment Firm X	Investeerimisühing X
(Trader 1 invest decn Client A Trader 1 invest decn Client B Trader 3 execution)	(Kaupleja 1 investeerimisotsus kliendile A Kaupleja 1 investeerimisotsus kliendile B Kaupleja 3 täidab)
Investment Firm Y	Investeerimisühing Y
(Trader 3 execution)	(kaupleja 3 täidab)
Trading Venue M	Kauplemiskoht M

Investeerimisühing X tegutseb kliendi A ja kliendi B nimel kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel. Kaupleja 1 otsustab osta kliendile A 400 ühikut teatud finantsinstrumenti. Kaupleja 2 otsustab osta kliendile B 200 ühikut sama finantsinstrumenti. Kaupleja 3 saadab koondkorralduse täitmiseks investeerimisühingule Y. Seejärel täidab kaupleja 4 korralduse kauplemiskohas M kahe tehinguga, üks 24. juunil 2018 kell 14.25.30,1264, 350 instrumenti hinnaga 30 eurot, ja teine 24. juunil 2018 kell 15.55.40,3452, 250 instrumenti hinnaga 32,5 eurot. Kauplemiskoht määrab tehingutele tunnuskoodid, vastavalt ‘1234’ ja ‘6789’.

Kui investeerimisühing X oleks aga fondivalitseja, mitte investeerimisühing, peaks investeerimisühing Y märkima ostjaks/müüjaks fondivalitseja ning otsustaja väljad tuleks jätta täitmata, sest fondivalitseja ei ole investeerimisühing, tal puudub tehinguaruandluse kohustus ja ta ei saa edastada.

Investeerimisühingu X aruandlus sõltub sellest, mis allpool kirjeldatud viisil kinnitab investeerimisühing Y täitmised investeerimisühingule X.

Ka kliendi A ja kliendi B aruandlus sõltub sellest, kuidas investeerimisühing X sooritused neile kinnitab.

Investeerimisühing X ei vasta komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimustele.

Investeerimisühing X kaupleb „muu volituse alusel“.

5.27.1.1 Investeerimisühing Y kinnitab kõik oma turupoole sooritused investeerimisühingule X

See peaks toimuma siis, kui sooritav maakler kaupleb „muu volituse alusel“ või sooritab kliendikorralduste sobitamistehingut.

Investeerimisühing Y kaupleb „muu volituse alusel“.

77. näide

Sama stsenaarium, nagu kirjeldatakse punkti 5.27.1 näites, kus sooritav maakler Y kinnitab iga turul sooritatud tehingu investeerimisühingule X.

Investeerimisühing X peab esitama aruande, sest ta ei vasta edastamise tingimustele.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X 1. aruandes	Väärtused investeerimisühingu X 2. aruandes	Väärtused investeerimisühingu X 3. aruandes	Väärtused investeerimisühingu X 4. aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y 2. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood					‘1234’	‘6789’
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
12	Ostja otsustaja kood			Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}		

16	Müüja tunnuskood	Investee-rimis-ühingu Y {LEI}	Investee-rimis-ühingu Y {LEI}	‘INTC’	‘INTC’	Kauple-miskoha M keskse vastas-poole {LEI}	Kauple-miskoha M keskse vastas-poole {LEI}
21	Müüja otsustaja kood						
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘true’	‘true’	‘true’	‘true’	‘false’	‘false’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood						
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood						
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-24T14:25:30Z’	‘2018-06-24T15:55:40Z’	‘2018-06-24T14:25:30Z’	‘2018-06-24T14:25:30Z’	‘2018-06-24T14:25:30.126Z’	‘2018-06-24T15:55:40.345Z’
29	Kauplemis-volitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘350’	‘250’	‘400’	‘200’	350	250
33	Hind	‘30’	‘32.5’	‘31.0416667’	‘31.0416667’	30	32,5
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’	Kauple-mis-koha M segmendi {MIC}	Kauple-mis-koha M segmen-di {MIC}
57	Ühingusisene investeerimis-otsus			Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}		
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 3 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 3 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 3 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 3 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}

Seejuures on investeerimisühingu X 3. ja 4. aruandes märgitud väljale 12 investeerimisühing X, sest investeerimisühing X tegutseb klientide A ja B kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel. Klientide A ja B nimel otsuse teinud kauplejate isikud tuleb märkida väljale 57.

XML:

Investeerimis-ühingu X 1. aruanne	Investeerimis-ühingu X 2. aruanne	Investeerimis-ühingu X 3. aruanne	Investeerimis-ühingu X 4. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>350</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">30</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:55:40Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <Qty> <Unit>250</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>400</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr> <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T14:25:30Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal>

<TradVn>XOFF</TradVn> … <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> … </New> </Tx>	<TradVn>XOFF</TradVn> … <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> … </New> </Tx>	<Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> … <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> … </New> </Tx>	<Amt Ccy="EUR">31.0416667</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> … <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> … </New> </Tx>

Investeerimisühingu Y 1. aruanne	Investeerimisühingu Y 2. aruanne
<Tx> <New> … <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> … <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id>

```
          <LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
          <LEI>11111111111111111111</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    <OrdrTrnsmssn>
      <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>
    </OrdrTrnsmssn>
    <Tx>
 <TradDt>2018-06-24T14:25:30.126Z</TradDt>
      <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
      <Qty>
        <Unit>350</Unit>
      </Qty>
      <Pric>
        <Pric>
          <MntryVal>
            <Amt Ccy="EUR">30</Amt>
          </MntryVal>
        </Pric>
      </Pric>
      <TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
    </Tx>
    ...
    <ExctgPrsn>
      <Prsn>
        …
        <Othr>
          <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id>
            <SchmeNm>
              <Prtry>CONCAT</Prtry>
             </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </ExctgPrsn>
    ...
  </New>
 </Tx>
```

```
          <LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>
          <LEI>11111111111111111111</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    <OrdrTrnsmssn>
      <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>
    </OrdrTrnsmssn>
    <Tx>
 <TradDt>2018-06-24T15:55:40.345Z</TradDt>
      <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
      <Qty>
        <Unit>250</Unit>
      </Qty>
      <Pric>
        <Pric>
          <MntryVal>
            <Amt Ccy="EUR">32.5</Amt>
          </MntryVal>
        </Pric>
      </Pric>
      <TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>6789</TradPlcMtchgId>
    </Tx>
    ...
    <ExctgPrsn>
      <Prsn>
        …
        <Othr>
          <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id>
          <SchmeNm>
            <Prtry>CONCAT</Prtry>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </ExctgPrsn>
    ...
  </New>
 </Tx>
```

Investeerimisühing X peaks aruandes lisaks klientidele jaotamisele kajastama turupoole tehingut investeerimisühinguga Y.

Investeerimisühing X esitab aruande iga talle investeerimisühingu Y poolt kinnitatud tehingu kohta klientide koondkontole ‘INTC’ ja seejärel aruande liikumiste kohta koondkontolt klientidele.

Kui investeerimisühing Y sooritaks kliendikorralduste sobitamistehingut, oleks aruandlus sama, v.a kauplemisvolitus, mille kohta märgitaks investeerimisühingu Y aruannetes väljale 29 ‘MTCH’.

5.27.1.2 Investeerimisühing Y kinnitab valmis tehingu investeerimisühingule X

See peaks toimuma siis, kui sooritav maakler Y kaupleb oma arvel.

78. näide

Sama stsenaarium kui eespool punkti 5.27.1 näites, kuid investeerimisühing Y kinnitab investeerimisühingule X valmis tehingu, mitte üksikud turusooritused. Aeg peaks olema teise soorituse aeg või hilisem, et kajastada aega, mil ta tegi jaotuse investeerimisühingule Y. Näide: Y kinnitab investeerimisühingule X, et on 24. juunil 2018 kell 16.06.20,34 ostnud 600 aktsiat hinnaga 31,0416667.

Investeerimisühing X peab esitama aruande, sest ta ei vasta edastamise tingimustele.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X 1. aruandes	Väärtused investeerimisühingu X 2. aruandes	Väärtused investeerimisühingu X 3. aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y 2. aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y 3. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood				‘1234’	‘6789’	
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
12	Ostja otsustaja kood		Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}			
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	‘INTC’	‘INTC’	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
21	Müüja otsustaja kood						

25	Korralduse indikaatori edastamine	‘true’	‘true’	‘true’	‘false’	‘false’	‘false’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseeri-miskood						
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseeri-miskood						
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-24T16:06:20Z’	‘2018-06-24T16:06:20Z’	‘2018-06-24T16:06:20Z’	‘2018-06-24T14:25:30.126Z’	‘2018-06-24T15:55:40.345Z’	‘2018-06-24T16:06:20Z’
29	Kauplemis-volitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘600’	‘400’	‘200’	‘350’	‘250’	‘600’
33	Hind	‘31.0416667’	‘31.0416667’	‘31.0416667’	‘30’	‘32.5’	‘31.0416667’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’	Kauple-mis-koha M segmendi {MIC}	Kauple-mis-koha M segmendi {MIC}	‘XOFF’
57	Ühingusisene investeerimis-otsus		Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 3 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 3 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 3 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}

XML:

Investeerimisühingu X 1. aruanne	**Investeerimisühingu X 2. aruanne**	**Investeerimisühingu X 3. aruanne**
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>

```
      ...
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQ
RST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnI
nd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-06-
24T16:06:20Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCp
cty>
        <Qty>
          <Unit>600</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">31.0416667</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      ...
      <ExctgPrsn>
        <Prsn>
          …
          <Othr>

<Id>BE12345678901</Id>
            <SchmeNm>
              <Cd>NIDN</Cd>
            </SchmeNm>
          </Othr>
        </Prsn>
      </ExctgPrsn>
      ...
    </New>
```

```
      ...
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAA
AAA</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
        <DcsnMakr>

<LEI>12345678901234567890
</LEI>
        </DcsnMakr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnI
nd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-06-
24T16:06:20Z</TradDt>

<TradgCpcty>AOTC</TradgCp
cty>
        <Qty>
          <Unit>400</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">31.0416667</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      ...
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>
          <Othr>

<Id>CA1112223334445555</Id
>
<SchmeNm>
  <Cd>CCPT</Cd>
 </SchmeNm>
```

```
      ...
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>BBBBBBBBBBBBBBB
BBBBB</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
        <DcsnMakr>

<LEI>12345678901234567890
</LEI>
        </DcsnMakr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Intl>INTC</Intl>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>true</TrnsmssnI
nd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-06-
24T16:06:20Z</TradDt>
<TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        <Qty>
          <Unit>200</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">31.0416667</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      ...
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>
          <Othr>

<Id>GBAB123456C</Id>
<SchmeNm>
  <Cd>CCPT</Cd>
 </SchmeNm>
          </Othr>
```

</Tx>	</Othr> ... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	... </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> … <Othr> <Id>BE12345678901</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>

Investeerimisühingu Y 1. aruanne	**Investeerimisühingu Y 2. aruanne**	**Investeerimisühingu Y 3. aruanne**
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> ... <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx>

```
        <TradDt>2018-06-
24T14:25:30.126.Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgCpc
ty>
        <Qty>
          <Unit>350</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">30</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>1234</TradPl
cMtchgId>
      </Tx>
      ...
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>
          <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAIR
</Id>
        <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
        </SchmeNm>
          </Othr>
          ...
        </Prsn>
      </InvstmtDcsnPrsn>
      <ExctgPrsn>
        <Prsn>
          …
          <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAIR
</Id>
        <SchmeNm>
          <Prtry>CONCAT</Prtry>
            </SchmeNm>
          </Othr>
        </Prsn>
      </ExctgPrsn>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

```
        <Tx>
          <TradDt>2018-06-
24T15:55:40.345Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgCpc
ty>
          <Qty>
            <Unit>250</Unit>
          </Qty>
          <Pric>
            <Pric>
              <MntryVal>
                <Amt
Ccy="EUR">32.5</Amt>
              </MntryVal>
            </Pric>
          </Pric>

<TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>6789</TradPl
cMtchgId>
        </Tx>
        ...
        <InvstmtDcsnPrsn>
          <Prsn>
            <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAIR
</Id>
          <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
          </SchmeNm>
            </Othr>
            ...
          </Prsn>
        </InvstmtDcsnPrsn>
        <ExctgPrsn>
          <Prsn>
            …
            <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAIR
</Id>
          <SchmeNm>
            <Prtry>CONCAT</Prtry>
          </SchmeNm>
            </Othr>
          </Prsn>
        </ExctgPrsn>
        ...
      </New>
    </Tx>
```

```
        <TradDt>2018-06-
24T16:06:20Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgC
pcty>
        <Qty>
          <Unit>600</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">31.0416667</A
mt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XOFF</TradVn>
      </Tx>
      ...
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>
          <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAI
R</Id>
          <SchmeNm>
<Cd>NIDN</Cd>
</SchmeNm>
          </Othr>
          ...
        </Prsn>
      </InvstmtDcsnPrsn>
      <ExctgPrsn>
        <Prsn>
          …
          <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAI
R</Id>
          <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
</SchmeNm>
          </Othr>
        </Prsn>
      </ExctgPrsn>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

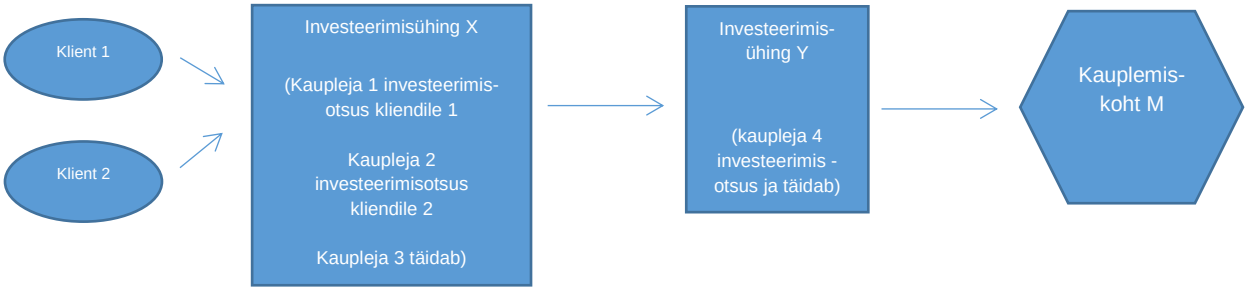
Nagu eespool, peaks investeerimisühing X aruandes lisaks klientidele jaotamisele kajastama turupoole tehingut investeerimisühinguga Y.

Et investeerimisühing Y kaupleb oma arvel, kinnitab ta valmis koondtehingu ühingule X, seega esitab investeerimisühing X tehinguaruande koondkoguse kohta klientide koondkontole ‘INTC’ ja seejärel aruande liikumiste kohta koondkontolt klientidele.

Kui investeerimisühing X koondab korraldusi ja täidab edastamise tingimused mõningate, kuid mitte kõigi korralduste puhul, vt punkt 5.26.4.3.

5.27.2 Investeerimisjuht tegutseb mitme kliendi kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel ja vastab edastamise tingimustele

79. näide



Klientide 1 ja 2 kaalutlusõigusel põhinevate volituste alusel tegutseva investeerimisühingu X järelevalve alla kuuluv kaupleja 1 otsustab müüa kliendi 1 nimel 500 aktsiat ja investeerimisühingu X järelevalve alla kuuluv kaupleja 2 otsustab müüa kliendi 2 nimel 200 aktsiat. Investeerimisühingu X järelevalve alla kuuluv kaupleja 3 saadab koondkorralduse 700 aktsiale investeerimisühingule Y. Investeerimisühingu Y järelevalve alla kuuluv kaupleja 4 võtab korralduse vastu ja täidab selle kauplemiskohas M 24. juunil 2018 kell 13.20.52,1456 ühe tehinguga ja hinnaga 21 eurot.

Investeerimisühing X on Ühendkuningriigi ühing ja investeerimisühing Y on Itaalia ühing.

Klient 1 müüb lühikeseks, klient 2 mitte. Investeerimisühingu Y positsioon oli enne turule müümist neutraalne, seega müüb ta turutehingu ajal lühikeseks.

Investeerimisühing X edastab investeerimisühingule kliendi 1 ja kliendi 2 andmed ja muu teabe, nagu näidatud allpool, ning täidab ka muud komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimused.

Investeerimisühing X peaks esitama investeerimisühingule Y järgmise teabe:

1) Finantsinstrumendi tunnuskood: instrumendi ISIN

2) Teave, et korraldus on tehtud finantsinstrumendi võõrandamiseks

3) Korralduse hind ja kogus: 700 aktsia turuhind

4) Otsustaja teave ja andmed: investeerimisühingu X LEI

5) Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik: GB

6) Investeerimisotsuse teinud investeerimisühingu X filiaali riik: GB

7) Edastava ühingu tunnuskood: investeerimisühingu X LEI

Seejärel (pärast täitmist, kuid edastamiskokkuleppega lubatava aja jooksul) esitab investeerimisühing X järgmise teabe:

8) Jaotused kliendile 1 ja kliendile 2

9) Müüjate teave: kliendi 1 riiklik klienditunnus ja kliendi 2 riiklik klienditunnus

10) Kliendi 1 andmed:

    a) eesnimi (-nimed) ja perekonnanimi (-nimed);
    b) sünnikuupäev

11) Kliendi 1 lühikeseks müügi indikaator: SESH (klient 1 müüb lühikeseks)

12) Kliendi 1 ühingus investeerimisotsuse eest vastutava isiku või algoritmi identifitseerimisandmed: kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}

13) Kliendi 2 andmed:

    a) eesnimi (-nimed) ja perekonnanimi (-nimed);
    b) sünnikuupäev

14) Kliendi 2 lühikeseks müügi indikaator: SELL (klient 2 ei müü lühikeseks)

15) Kliendi 2 ühingus investeerimisotsuse eest vastutava isiku või algoritmi identifitseerimisandmed: kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}

Investeerimisühing Y tegutseb oma arvel ja kannab väärtpaberid investeerimisühingule X samal päeval kell 15.00.12,51.

Mis peab olema investeerimisühingu Y aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Y 2. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Y 3. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’		
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}
12	Ostja otsustaja kood			
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kliendi 2 {RIIKLIK_TUNNUS}
18	Müüja – eesnimi (-nimed)		‘JEAN’	‘JOSE, LUIS’
19	Müüja – perekonnanimi (-nimed)		‘COCTEAU’	‘RODRIGUEZ DE LA TORRE’
20	Müüja – sünniaeg		‘1962-06-04’	‘1976-02-27’
21	Müüja otsustaja kood		Ühingu X {LEI}	Ühingu X {LEI}

25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’	‘false’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood			
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood		Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-24T13:20:52.1456Z’	‘2018-06-24T15:00:12Z’	‘2018-06-24T15:00:12Z’
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’
30	Kogus	‘700’	‘500’	‘200’
33	Hind	‘21’	‘21’	‘21’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’
57	Ühingusisene investeerimisotsus	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik	‘IT’	‘GB’	‘GB’
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	‘IT’	‘IT’	‘IT’
62	Lühikeseks müügi indikaator	‘SESH’	‘SESH’	‘SELL’

XML:

Investeerimisühingu Y 1. aruanne	Investeerimisühingu Y 2. aruanne	Investeerimisühingu Y 3. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr>

```
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>11111111111111111111
</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQ
RST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>false</Trnsmss
nInd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-06-
24T15:00:12Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgCpc
ty>
        <Qty>
          <Unit>700</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">21</Amt>
            </MntryVal>
          </Pric>
        </Pric>

<TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>1234</TradPl
cMtchgId>
      </Tx>
      ...
      <InvstmtDcsnPrsn>
        <Prsn>

<CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch
>
          <Othr>

<Id>FR19631202MARIECLAIR
</Id>
  <SchmeNm>
<Prtry>CONCAT</Prtry>
```

```
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQ
RST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Prsn>

<FrstNm>JEAN</FrstNm>

<Nm>COCTEAU</Nm>
            <BirthDt>1962-06-
04BirthDt>
              <Othr>

<Id>FR19620604JEAN#COCT
E</Id>
                <SchmeNm>
      <Prtry>CONCAT</Prtry>
                </SchmeNm>
              </Othr>
            </Prsn>
          </Id>
        </AcctOwnr>
        <DcsnMakr>

<LEI>12345678901234567890
</LEI>
        </DcsnMakr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>false</Trnsmss
nInd>

<TrnsmttgSellr>123456789012
34567890</TrnsmttgSellr>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-06-
24T15:00:12Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgCpc
ty>
        <Qty>
          <Unit>500</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt
Ccy="EUR">21</Amt>
```

```
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOP
QRST</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <Prsn>
              <FrstNm>JOSE,
LUIS</FrstNm>

<Nm>RODRIGUEZ, DE LA
TORRE</Nm>
              <BirthDt>1976-02-
27-</BirthDt>
              <Othr>

<Id>ES99156722T</Id>
                <SchmeNm>
                  <Cd>NIDN</Cd>
                </SchmeNm>
              </Othr>
              ...
            </Prsn>
          </Id>
        </AcctOwnr>
        <DcsnMakr>

<LEI>12345678901234567890
</LEI>
        </DcsnMakr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>

<TrnsmssnInd>false</Trnsms
snInd>

<TrnsmttgSellr>12345678901
234567890</TrnsmttgSellr>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        <TradDt>2018-06-
24T15:00:12Z</TradDt>

<TradgCpcty>DEAL</TradgC
pcty>
        <Qty>
          <Unit>200</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
```

</SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	</MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> … <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> … <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> … </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Kui aga investeerimisühing Y kauples „muu volituse alusel“, siis mis peab olema investeerimisühingu Y aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Y 2. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Y 3. aruandes

3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’		
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	‘INTC’	‘INTC’
12	Ostja otsustaja kood			
16	Müüja tunnuskood	‘INTC’	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kliendi 2 {RIIKLIK_TUNNUS}
18	Müüja – eesnimi (-nimed)		‘JEAN’	‘JOSE, LUIS’
19	Müüja – perekonnanimi (-nimed)		‘COCTEAU’	‘RODRIGUEZ DE LA TORRE’
20	Müüja – sünniaeg		‘1962-06-04’	‘1976-02-27’
21	Müüja otsustaja kood		Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’	‘false’
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood			
27	Müüja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimis-kood		Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
28	Kauplemise kuupäev ja aeg	‘2018-06-24T13:20:52.1456Z’	‘2018-06-24T13:20:52.1456Z’	‘2018-06-24T13:20:52.1456Z’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
30	Kogus	‘700’	‘500’	‘200’
33	Hind	‘21’	‘21’	‘21’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’
57	Ühingusisene investeerimisotsus		Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}
58	Investeerimis-otsuse teinud isiku		‘GB’	‘GB’

	eest vastutava filiaali riik			
59	Ühingusisene täitmine	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}	Kaupleja 4 {RIIKLIK_TUNNUS}
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik	'IT'	'IT'	'IT'
62	Lühikeseks müügi indikaator		'SESH'	'SELL'

XML:

Investeerimisühingu Y 1. aruanne	**Investeerimisühingu Y 2. aruanne**	**Investeerimisühingu Y 3. aruanne**
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>700</Unit> </Qty> <Pric> <Pric>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JEAN</FrstNm> <Nm>COCTEAU</Nm> <BirthDt>1962-06-04</BirthDt> <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> <FrstNm>JOSE, LUIS</FrstNm> <Nm>RODRIGUEZ, DE LA TORRE</Nm> <BirthDt>1976-02-27</BirthDt> <Othr> <Id>ES99156722T</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> <DcsnMakr>

<MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> ... <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> ... </New> </Tx>	 <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>500</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>CA1112223334445555</Id> <SchmeNm> <Cd>CCPT</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id>	 <LEI>12345678901234567890</LEI> </DcsnMakr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgSellr>12345678901234567890</TrnsmttgSellr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> <TradDt>2018-06-24T15:00:12Z</TradDt> <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> <Qty> <Unit>200</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">21</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> ... <InvstmtDcsnPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>GB</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>GBAB123456C</Id> <SchmeNm> <Cd>NIDN</Cd> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </InvstmtDcsnPrsn> <ExctgPrsn> <Prsn> <CtryOfBrnch>IT</CtryOfBrnch> <Othr> <Id>FR19631202MARIECLAIR</Id> <SchmeNm>

	<SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SESH</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx>	<Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </ExctgPrsn> <AddtlAttrbts> <ShrtSellgInd>SELL</ShrtSellgInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

Kui investeerimisühing Y tegutseks kliendikorralduste sobitamise teel, oleksid aruanded täpselt samad kui eespool, kuid kauplemisvolituseks oleks märgitud ‘MTCH’.

5.28 Otsene elektrooniline juurdepääs

Tehinguaruande peaks esitama nii otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja kui ka otsese elektroonilise juurdepääsu klient, kui tegu on investeerimisühinguga (v.a variandis B kirjeldatud erandi korral).

Tehinguaruandluses peaks otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja alati märkima sooritavaks isikuks iseenda (väli 4, „Sooritava isiku tunnuskood“). Kuivõrd otsese elektroonilise juurdepääsu kasutaja (klient) otsustab, kuidas täita tehingukorraldust, peab otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja märkima ühingusisese täitmise väljale ‘NORE’, nagu on sätestatud punktis **Error! Reference source not found.**. Otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja ei peaks kunagi täitma välja 57 („Ühingusisene investeerimisotsus“), sest ta ei osale kunagi investeerimisotsuse tegemisel ja selle eest vastutab otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient. Samuti peaks otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja esitama aruanded muu volituse alusel või kliendikorralduste sobitamise teel tegutsejana (väli 29).

Otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient peaks oma tehinguaruandes vastavalt ostjaks (väli 7, „Ostja tunnuskood“) või müüjaks (väli 16, „Müüja tunnuskood“) märkima otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja, mitte turu. Lisaks peaks klient väljale 36 („Koht“) alati märkima ‘XOFF’, sest ta ei ole vahetult turul tegutseja. NB! Kui otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient tegutseb oma kliendi nimel ja on selle kliendi andmed edastanud vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud tingimustele, ei peaks otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient tehinguaruannet esitama, sest kogu vajalik tehinguteave esitatakse pädevale asutusele otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja tehinguaruandes.

5.28.1 1. stsenaarium: otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient kaupleb oma arvel ja tal puudub aluseks olev klient

80. näide

Investeerimisühing X (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient) kasutab investeerimisühingu Y (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja) liikmekoodi korralduse esitamiseks kauplemiskohale M. Investeerimisühingu X korralduse sisuks on finantsinstrumentide ostmine kauplemiskohas M. Investeerimisühingus X on investeerimisotsused teinud kaupleja 1 ja kaupleja 2 vastutab

täitmiskorralduse esitamise eest investeerimisühingu Y pakutava otsese elektroonilise juurdepääsu süsteemi kaudu. Kauplemiskoht M genereerib kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi (TVTIC) ‘1234’.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeerimisühingu X 2. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’	
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
12	Ostja otsustaja kood		
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
21	Müüja otsustaja kood		
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	‘false’
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	‘DEAL’
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	‘XOFF’
57	Ühingusisene investeerimisotsus		Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
59	Ühingusisene täitmine	‘‘NORE’	Kaupleja 2 {RIIKLIK_TUNNUS}

XML:

1. aruanne, investeerimisühing Y (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja)	1. aruanne, investeerimisühing X (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient)
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>

```
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      <OrdrTrnsmssn>
        <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>
      </OrdrTrnsmssn>
      <Tx>
        …
        <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
        …
        <TradVn>XMIC</TradVn>

<TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
      </Tx>
      ...
      <ExctgPrsn>
        <Clnt>NORE</Clnt>

      </ExctgPrsn>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

```
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    <OrdrTrnsmssn>
      <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>
    </OrdrTrnsmssn>
    <Tx>
      …
      <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>
      …
      <TradVn>XOFF</TradVn>
    </Tx>
    ...
    <InvstmtDcsnPrsn>
      <Prsn>
        …
        <Othr>
          <Id>CA1112223334445555</Id>
          <SchmeNm>
            <Cd>CCPT</Cd>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </InvstmtDcsnPrsn>
    <ExctgPrsn>
      <Prsn>
        …
        <Othr>
          <Id>GBAB123456C</Id>
          <SchmeNm>
            <Cd>NIDN</Cd>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </ExctgPrsn>
    ...
  </New>
</Tx>
```

Selle stsenaariumi korral on kaupleja, kes teeb investeerimisühingus X investeerimisotsuse, ja kaupleja, kes esitab korralduse täitmiseks, erinevad isikud. Kui investeerimisühingus X vastutab nii investeerimisotsuse kui ka selle täitmise eest sama isik, tuleks ühingu X aruannetes väljadele 57 ja 59 märkida selle kaupleja riiklik tunnus.

5.28.2 2. stsenaarium: otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient tegutseb kliendi nimel

5.28.2.1 Variant A: otsese elektroonilise juurdepääsu pakkujale ei edastata kliendi andmeid

81. näide

Investeerimisühing X (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient) kasutab investeerimisühingu Y (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja) liikmekoodi korralduse esitamiseks kauplemiskohale M. Investeerimisühingu X korralduse sisuks on finantsinstrumentide ostmine kauplemiskohas M.

Investeerimisühing X tegutseb kliendi 1 nimel, kelle andmeid investeerimisühingule Y ei edastata. Investeerimisotsuse on teinud klient 1. Investeerimisühingus Y vastutab täitmiskorralduse esitamise eest investeerimisühingu Y pakutava otsese elektroonilise juurdepääsu süsteemi kaudu kaupleja 1. Kauplemiskoht M genereerib kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi 1234.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeerimisühingu X 1. aruandes
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	'1234'	
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
12	Ostja otsustaja kood		
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
21	Müüja otsustaja kood		
25	Korralduse indikaatori edastamine	'false'	'true'
29	Kauplemisvolitused	'AOTC'	'AOTC'
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	'XOFF'
57	Ühingusisene investeerimisotsus		
59	Ühingusisene täitmine	"NORE'	Kaupleja 1 {RIIKLIK_TUNNUS}

XML:

1. aruanne, investeerimisühing Y (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja)	2. aruanne, investeerimisühing X (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient)
<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Prsn> … <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> <Othr>

```
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    <OrdrTrnsmssn>
      <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd>
    </OrdrTrnsmssn>
    <Tx>
      …
      <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
      …
      <TradVn>XMIC</TradVn>
     <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId>
    </Tx>
    …
    <ExctgPrsn>
      <Clnt>NORE</Clnt>

    </ExctgPrsn>
    ...
  </New>
</Tx>
```

```
          </Prsn>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    <OrdrTrnsmssn>
      <TrnsmssnInd>true</TrnsmssnInd>
    </OrdrTrnsmssn>
    <Tx>
      …
      <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty>
      …
      <TradVn>XOFF</TradVn>
    </Tx>
    …
    <ExctgPrsn>
      <Prsn>
        …
        <Othr>
          <Id>CA1112223334445555</Id>
          <SchmeNm>
            <Cd>CCPT</Cd>
          </SchmeNm>
        </Othr>
      </Prsn>
    </ExctgPrsn>
    …
  </New>
</Tx>
```

5.28.2.2 Variant B: otsese elektroonilise juurdepääsu pakkujale edastatakse kliendi andmed

82. näide

Investeerimisühing X (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja klient) kasutab investeerimisühingu Y (otsese elektroonilise juurdepääsu pakkuja) liikmekoodi korralduse esitamiseks kauplemiskohale M. Investeerimisühingu X korralduse sisuks on finantsinstrumentide ostmine kauplemiskohas M. Investeerimisühing X tegutseb kliendi 1 nimel, kelle andmed edastatakse investeerimisühingule Y vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklile 4. Kauplemiskoht M genereerib kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi 1234. Et investeerimisühing X vastab komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimustele, ei peaks ta esitama tehinguaruannet.

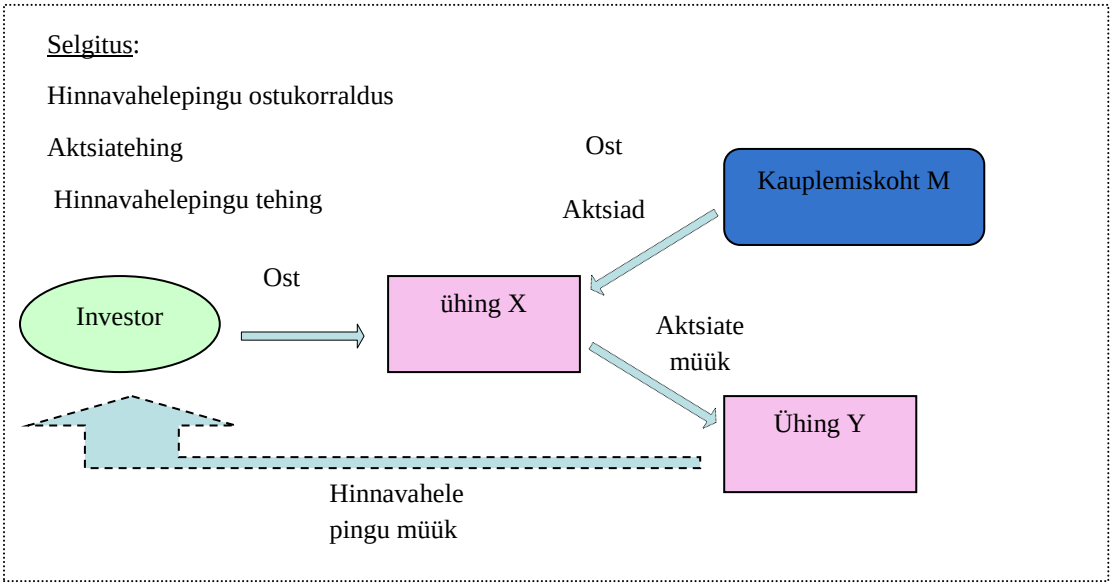
Mis peab olema investeerimisühingu Y aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu Y aruandes	XML
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘1234’	<Tx> <New> … <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> … <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <OrdrTrnsmssn> <TrnsmssnInd>false</TrnsmssnInd> <TrnsmttgBuyr>12345678901234567890</TrnsmttgBuyr> </OrdrTrnsmssn> <Tx> … <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> … <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>1234</TradPlcMtchgId> </Tx> <ExctgPrsn> <Clnt>NORE</Clnt> </ExctgPrsn> … </New> </Tx>
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	
7	Ostja tunnuskood	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}	
12	Ostja otsustaja kood		
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	
21	Müüja otsustaja kood		
25	Korralduse indikaatori edastamine	‘false’	
26	Ostja nimel tegutseva edastava ühingu identifitseerimiskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
29	Kauplemisvolitused	‘AOTC’	
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	
57	Ühingusisene investeerimisotsus		
58	Investeerimisotsuse teinud isiku eest vastutava filiaali riik		
59	Ühingusisene täitmine	‘NORE’	
60	Täitmise eest vastutava isiku üle järelevalvet tegeva filiaali riik		

5.29 Riskimaandamine hinnavahelepingutega

83. näide

Klient 1 annab investeerimisühingule X korralduse osta hinnavahelepingud konkreetsele alusaktsiale (nt Vodafone). Alusaktsia ISIN-kood on GB00BH4HKS39. Investeerimisühing X ostab aktsia kauplemiskohas M (et riski maandada) ja annab tehingu üle (müüb aktsia) investeerimisühingule Y (oma peamaaklerile), kes seejärel sõlmib hinnavahelepingu otse kliendiga 1. Nii investeerimisühing X kui ka investeerimisühing Y kauplevad oma arvel.



Selle stsenaariumi korral peaks nii investeerimisühingul X kui ka investeerimisühingul Y olema tehinguaruandluse kohustus, sest mõlemad on sooritanud tehinguid: investeerimisühing X on ostnud ja müünud aktsia ning investeerimisühing Y on ostnud ja müünud aktsia ning müünud kliendile 1 hinnavahelepingu.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X 1. aruandes	Väärtused investeerimis ühingu X 2. aruandes	Väärtused investeerimis ühingu Y 1. aruandes	Väärtused investeerimis-ühingu Y 2. aruandes[32]
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	Kliendi 1 {RIIKLIK_TUNNUS}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemis-koha M keskse	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu Y {LEI}

[32] Hinnavahelepingute teatamise lisateave on punktis 0.

		vastaspoole {LEI}			
29	Kauplemis-volitused	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’	‘DEAL’
36	Koht	Kauplemis-koha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XXXX’
41	Instrumendi tunnuskood	Vodafone’i aktsia {ISIN}	Vodafone’i aktsia {ISIN}	Vodafone’i aktsia {ISIN}	
42	Instrumendi täisnimi				‘VODAFONE CFD’

XML:

Investeerimis-ühingu X 1. aruanne	Investeerimis-ühingu X 2. aruanne	Investeerimis-ühingu Y 1. aruanne	Investeerimis-ühingu Y 2. aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> ... </Tx> ...	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XOFF</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm>	<Tx> <New> <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Prsn> … <Othr> <Id>FR19620604JEAN#COCTE</Id> <SchmeNm> <Prtry>CONCAT</Prtry> </SchmeNm> </Othr> </Prsn> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> … <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty>

<FinInstrm> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </FinInstrm> </New> </Tx>	<Id>GB00BH4HKS39</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>	<Id>GB00BH4HKS39</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>	… <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>VODAFONE CFD</FullNm> … </FinInstrmGnlAttrbts> … </Othr> </FinInstrm> … </New> </Tx>

Investeerimisühingu Y 2. aruanne sisaldaks instrumendi muid viiteandmeid, mida ei ole eespool esitatud. Börsivälised hinnavahelepingud: vt suuniste IV osa.

5.30 Kauplemiskoha aruanne tema süsteemide kaudu sooritatud tehingu kohta vastavalt MiFIRi artikli 26 lõikele 5

MiFIRi artikli 26 lõike 5 kohaselt peavad kauplemiskohad esitama tehinguaruanded nende platvormidega seotud finantsinstrumentidega tehtud tehingute kohta, mille on nende süsteemides sooritanud MiFIRi reguleerimisalasse mittekuuluvad ühingud.

Kauplemiskoht peab esitama kõik andmed, mille peaks vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabelile 2 aruandes esitama ühing ise, kui ta kuuluks MiFIRi kohaldamisalasse, sealhulgas ühingusisese investeerimisotsuse ja ühingusisese täitmise teabe, vabastused ja indikaatorid ning kliendi identifitseerimisandmed, kui asjakohane. Kui ühing kaupleb oma arvel, tuleks need andmed esitada ühingu vaatepunktist. Kui ühing kaupleb kliendi nimel kliendikorralduste sobitamise teel või „muu volituse alusel“, peaks kauplemiskoht märkima täiendavad andmed väljadele 8–15 (kui klient ostab) või väljadele 17–24 (kui klient müüb) ning kliendi lühikeseks müügi indikaatori või kaubatuletisinstrumendi indikaatori, nagu asjakohane. Lühikeseks müügi ja kaubatuletisinstrumendi indikaatorid tuleks märkida kliendi vaatepunktist. Sooritava ühingu tunnuse (väli 4) ja tema kliendi suhtes (väljad 7 ja 16), juhul kui talle saaks määrata LEI, kohaldatakse komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 5 ja artikli 13 lõike 3 ning MiFIRi artikli 26 lõike 6 nõudeid. Klientide korral, kellele ei saa LEI-koodi määrata, peab kauplemiskoht kontrollima, et esitatud riiklikus tunnuses ei oleks ilmseid vigu ega puudusi.

5.30.1 Ühing kaupleb oma arvel.

84. näide

Ühing R, kes ei ole investeerimisühing, ostab kauplemiskohas M kliendi jaoks finantsinstrumente. Ühingu R LEI on ‘RRRRRRRRRRRRRRRRRRR’. Kauplemiskoha korraldaja LEI on

‘TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV’. Kauplemiskoht genereerib kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi (TVTIC) ‘55555555’ ja tehinguaruande tehingu viitenumbri ‘6868689’.

Mis peab olema kauplemiskoha M aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
2	Tehingu viitenumber	‘6868689’	<Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>RRRRRRRRRRRRRRRRRRRR</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>DEAL</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx>
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘55555555’	
4	Sooritava isiku tunnuskood	Ühingu R {LEI}	
5	Direktiivi 2014/65/EL kohaldamisalasse kuuluv investeerimisühing	‘false’	
6	Esitava isiku tunnuskood	Kauplemiskoha M korraldaja {LEI}	
7	Ostja tunnuskood	Ühingu R {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kauplemiskoha M keskse vastaspoole {LEI}	
29	Kauplemisvolitused	‘DEAL’	
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	

Instrumendiga seotud väljad tuleks täita vastavalt IV osas kirjeldatule.

Kui ühing teeb seonduva börsivälise tehingu kliendiga, ei pea kauplemiskoht selle kohta aruannet esitama, sest seda ei sooritata kauplemiskoha süsteemide kaudu.

5.30.2 Ühing kaupleb „kliendikorralduste sobitamise teel“ või „muu volituse alusel“ üksnes ühe kliendi nimel

85. näide

Ühing R, kes ei ole investeerimisühing, ostab kauplemiskoha M tellimusraamatus aktsiaid kliendile, ühingule S, kes tegutseb samuti kliendi nimel (klient T). Ühingu R LEI on ‘RRRRRRRRRRRRRRRRRRR’. Ühingu S LEI on ‘SSSSSSSSSSSSSSSSSSS’. Kauplemiskoha korraldaja LEI on ’TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV’. Kauplemiskoht genereerib kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi (TVTIC) ‘55555555’ ja tehinguaruande tehingu viitenumbri ‘6868689’.

Kui ühing R tegutseb „muu volituse alusel“, esitab kauplemiskoht aruande järgmiselt:

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
2	Tehingu viitenumber	‘6868689’	<Tx> <New> ... <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> .... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>SSSSSSSSSSSSSSSSSSS</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>MTCH</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn> <TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx>
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘55555555’	
4	Sooritava isiku tunnuskood	Ühingu R {LEI}	
5	Direktiivi 2014/65/EL kohaldamisalasse kuuluv investeerimis-ühing	‘false’	
6	Esitava isiku tunnuskood	Kauplemis-koha M korraldaja {LEI}	
7	Ostja tunnuskood	Ühingu S {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Kauplemis-koha M keskse vastaspoole {LEI}	
29	Kauplemis-volitused	‘AOTC’	
36	Koht	Kauplemis-koha M segmendi {MIC}	

Instrumendiga seotud väljad tuleks täita vastavalt IV osas kirjeldatule.

Et ühing R kaupleb „muu volituse alusel“, tuleb kauplemiskoha esitatavasse tehinguaruandesse märkida vahetu aluseks olev klient (ühing S), mitte klient T.

Kui ühing R kaupleks kliendikorralduste sobitamise teel, oleksid aruanded identsed, v.a kauplemisvolituse väli, kuhu oleks märgitud ‘MTCH’.

5.30.3 Ühing koondab mitme kliendi korraldusi

Kui ühing koondab kauplemiskohas mitme kliendi korraldusi ja tegutseb „muu volituse alusel“ või kliendikorralduste sobitamise teel, peaks kauplemiskoht aruandes esitama kõigi klientide andmed. Sealhulgas tuleks aruande väljadel 8–15 esitada täiendavad andmed ostja kohta ja samaväärsetel väljadel müüja kohta ning kliendi lühikeseks müügi indikaator ja kliendi kaubatuletisinstrumendi indikaator, kui asjakohane.

86. näide

Ühing R, kes ei ole investeerimisühing, ostab kauplemiskoha M tellimusraamatus aktsiaid kolmele kliendile, klientidele A, B ja C. Ühing R tegutseb „muu volituse alusel“. Kauplemiskoha korraldaja LEI on ‘TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV’. Kauplemiskoht genereerib kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi (TVTIC) ‘55555555’ ja turutehingu aruandele tehingu viitenumbri ‘6868689’ ning klientide jaotustele viitenumbrid ‘6868690’, ‘6868691’ ja ‘6868692’.

Mis peab olema kauplemiskoha M aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused kauplemis-koha M 1. aruandes	Väärtused kauplemis-koha M 2. aruandes	Väärtused kauplemis-koha M 3. aruandes	Väärtused kauplemis-koha M 4. aruandes
2	Tehingu viitenumber	‘6868689’	‘6868690’	‘6868691’	‘6868692’
3	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	‘55555555’			
4	Sooritava isiku tunnuskood	Ühingu R {LEI}	Ühingu R {LEI}	Ühingu R {LEI}	Ühingu R {LEI}
5	Direktiivi 2014/65/EL kohaldamis-alasse kuuluv investeerimis-ühing	‘false’	‘false’	‘false’	‘false’
6	Esitava isiku tunnuskood	Kauplemis-koha M korraldaja {LEI}	Kauplemis-koha M korraldaja {LEI}	Kauplemis-koha M korraldaja {LEI}	Kauplemis-koha M korraldaja {LEI}
7	Ostja tunnuskood	‘INTC’	Kliendi A {LEI}	Kliendi B {LEI}	Kliendi C {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Kauplemis-koha M keskse	‘INTC’	‘INTC’	‘INTC’

		vastaspoole {LEI}			
29	Kauplemis-volitused	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’	‘AOTC’
36	Koht	Kauplemis-koha M segmendi {MIC}	‘XOFF’	‘XOFF’	‘XOFF’

XML:

Kauplemiskoha M 1. aruanne	Kauplemiskoha M 2. aruanne	Kauplemiskoha M 3. aruanne	Kauplemiskoha M 4. aruanne
<Tx> <New> <TxId>6868689</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>11111111111111111111</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> ... <TradVn>XMIC</TradVn>	<Tx> <New> <TxId>6868690</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> … <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> … <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> </New>	<Tx> <New> <TxId>6868691</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> … <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> … <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx>	<Tx> <New> <TxId>6868692</TxId> <ExctgPty>RRRRRRRRRRRRRRRRRRR</ExctgPty> <InvstmtPtyInd>false</InvstmtPtyInd> <SubmitgPty>TVTVTVTVTVTVTVTVTVTV</SubmitgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <Intl>INTC</Intl> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> … <TradgCpcty>AOTC</TradgCpcty> … <TradVn>XOFF</TradVn>

<TradPlcMtchgId>55555555</TradPlcMtchgId> </Tx> ... </New> </Tx>	</Tx>	… </New> </Tx>>	</Tx> … </New> </Tx>

Kui ühing R kaupleks kliendikorralduste sobitamise teel, oleksid aruanded identsed, v.a kauplemisvolituse väli, kuhu oleks märgitud 'MTCH'.

5.31 Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingud

Aruandluskohustuse kohaldamise üldine kirjeldus väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingute puhul on punkti 5.6.2 vastavates alapunktides (komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõike 5 punkti a kohased erandid).

87. näide

Keskpank CB (kelle LEI on CBCBCBCBCBCBCBCBCBCB) ostab investeerimisühingult X riigivõlakirju (ISIN NO0010732555).

Alljärgnev tehinguaruanne kajastab üksnes investeerimisühingu X vaatepunkti.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CBCBCBCBCBCBCBCBCBCB</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <FinInstrm> <Id>NO0010732555</Id> </FinInstrm> <AddtlAttrbts>
7	Ostja tunnuskood	Keskpanga CB {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
41	Instrumendi tunnuskood	{Riigivõlakirja ISIN}	
65	Väärtpaberite kaudu finantseerimise tehingu indikaator	'true'	

			… <SctiesFincgTxInd>true</SctiesFincgTxInd> </AddtlAttrbts> </New> </Tx>

IV osa. Eri liiki instrumentide aruandlus

5.32 Põhimõtted

Kui tuletisinstrument põhineb omakorda tuletisinstrumendil, näiteks optsioon aktsiafutuuril, on tehinguaruandes aluseks oleva instrumendi koodi väljale (väli 47) märgitav ISIN-kood vahetu aluseks oleva instrumendi kood, st siin näites futuurlepingu, mitte selle aluseks oleva instrumendi (siin näites aktsia) kood. See ei kehti tuletisinstrumendi korral, mis on kauplemiskohas kauplemisele lubatud või millega kauplemiskohas kaubeldakse, sest kohaldatakse üksnes instrumendi tunnuskoodi (väli 41).

Kui konkreetsel tehingul puudub hind (nt kinketehingul), tuleks hinna väljale märkida ‘NOAP’. Kui hind ei ole veel teada, vaid selgub hiljem, tuleks märkida ‘PNDG’. Vaikeväärtusena ei tohi kasutada väärtust 0.

Finantsinstrumentide kohta, mille aluseks on indeks, tuleks esitada aruanded. See hõlmab ka juhtumeid, kus aluseks on „kauplemiskohas kaubeldavatest finantsinstrumentidest koosnev“ indeks. Seejuures tuleks MiFIRi artikli 26 lõike 2 punkti c teksti lugeda nii, et „kauplemiskohas kaubeldavatest finantsinstrumentidest koosnev“ võib olla nii indeks kui ka korv.

5.33 Kauplemiskohas kaubeldavate või ESMA nimekirjas sisalduvate finantsinstrumentide identifitseerimine

88. näide

Investeerimisühing omandab finantsinstrumendi (ISIN-kood BE9999999999).

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	<Tx> <New> .. <FinInstrm> <Id>BE9999999999</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
42	Instrumendi täisnimi		
43	Instrumendi liigitus		
44	Tinglik valuuta 1		
45	Tinglik valuuta 2		
46	Hinnakordaja		
47	Aluseks oleva instrumendi kood		
48	Aluseks oleva indeksi nimi		
49	Aluseks oleva indeksi kehtivusaeg		
50	Optsiooni liik		
51	Täitmishind		
52	Täitmishinna valuuta		
53	Optsiooni täitmise tüüp		

54	Lõpptähtaeg		
55	Aegumise kuupäev		
56	Ülekande liik		

Sel juhul tuleks täita üksnes instrumendi tunnuskoodi väli. Kui täidetud on ka instrumendi võrdlusandmete väljad, ei peaks pädev asutus tehinguaruannet siiski tagasi lükkama.

5.34 Kauplemiskohas mittekaubeldavate või ESMA nimekirjas puuduvate finantsinstrumentide identifitseerimine

5.34.1 Finantsinstrumendid, millega kaubeldakse Euroopa Liidu välisel organiseeritud kauplemisplatvormil (EMP-välises kauplemiskohas)

89. näide

Investeerimisühing kaupleb väljaspool Euroopa Liitu asuval organiseeritud kauplemisplatvormil (kauplemisplatvorm U) tuletisinstrumentidega (futuurlepingud, ISIN US0000000000) hinnaga 11,4653 dollarit aluseks oleva instrumendi kohta. Aluseks oleva instrumendiga (ISIN GB0000000000) kaubeldakse kauplemiskohas.

Ühe tuletislepinguga seotud alusvaraks oleva väärtpaberi ühikute arv on 1000.

Futuurlepingu CFI-kood on FFSCSX ja leping täidetakse rahas.

EMP-välise kauplemiskoha segmendi MIC on XUSA ja futuurlepingu tähtpäev on 19. juuni 2018.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
36	Koht	Kauplemis-platvormi U segmendi {MIC}	<New> ... <Tx> … <TradVn>XUSA</TradVn> … </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000000</Id> <FullNm>FUTURE CONTRACT</FullNm> <ClssfctnTp>FFSCSX</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-06-19</XpryDt> <PricMltplr>1000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000000</ISIN> </Sngl>
41	Instrumendi tunnuskood	{Futuuride ISIN}	
42	Instrumendi täisnimi	‘FUTURE CONTRACT’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘1000’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva väärtpaberi {ISIN}	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-06-19’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			</Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New>

Kui Euroopa Liidu välisel organiseeritud kauplemisplatvormil kaubeldaval finantsinstrumendil on ISIN-kood, märgitakse see väljale 41. Kui see ISIN ESMA võrdlusandmete loendis puudub, tuleks täita ka väljad 42–56.

5.34.2 Börsivälised tuletisinstrumendid

90. näide

Investeerimisühing kaupleb börsiväliselt futuurlepingutega. Futuurlepingutel puudub ISIN, kuid aluseks olev instrument (ISIN GB0000000000) on kauplemiskohas kauplemisele lubatud või kaubeldakse sellega kauplemiskohas.

Ühe tuletislepinguga seotud alusvaraks oleva väärtpaberi ühikute arv on 1000.

Futuurlepingu CFI-kood on FFSCSX ja futuurlepingu tähtpäev on 19. juuni 2018. Leping täidetakse rahas.

Ka hinnakordaja väli täidetakse vahetu aluseks oleva instrumendi andmetega.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
36	Koht	‘XXXX’	<New> ... <Tx> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> ... <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FUTURE CONTRACT JUN 2018</FullNm> <ClssfctnTp>FFSCSX</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-6-19</XpryDt> <PricMltplr>1000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp>
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘FUTURE CONTRACT JUN 2018’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘1000’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva instrumendi {ISIN}	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-06-19’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			</DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Punktide 5.34.1 ja 5.34.2 erinevus on, et punkti 5.34.2 stsenaariumi korral ei märgita instrumendi tunnuskoodi (väli 41).

5.35 Konkreetsete finantsinstrumentide aruandlus

5.35.1 Aktsiad ja aktsialaadsed instrumendid

91. näide

Investeerimisühing kaupleb USA turul (MIC: XUSA) 10 Ameerika-tüüpi hoidmistunnistusega (ISIN: US0000000001). Aluseks olev instrument (ISIN: GB0000000001) on kauplemiskohas kauplemisele lubatud või sellega kaubeldakse kauplemiskohas. CFI-kood on EDSXFB.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	'10'	<Tx> <New> ... <Tx> … <Qty> <Unit>10</Unit> </Qty> … <TradVn>XUSA</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <Id>US0000000001</Id> <ClssfctnTp>EDSXFB</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
36	Koht	Kauplemis-platvormi U segmendi {MIC}	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	'1'	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva instrumendi {ISIN}	

5.35.2 Võlakirjad või muus vormis väärtpaberistatud võlad

5.35.2.1 Stsenaarium, kus tehing tehti puhashinnaga[33]

92. näide

Investeerimisühing omandab võlakirja või väärtpaberistatud võla finantsinstrumendi EDF 2,25% 2021 (ISIN-kood FR0011637586) börsivälises kauplemises hinnaga 98. Tehingu nominaalhind on 1 000 000 eurot.

Tehingu netohind on 982 650,68 eurot.

Näite eeldused:

Püsiandmed (mis on määratletud finantsinstrumendi emiteerimisel)

- Tähtpäev: 27. aprill 2021
- Nominaalkupong: 2,25%
- Kupongi sagedus: aasta
- Päevaarvestuse meetod: ACT/ACT (tegelik/tegelik)[34]
- Arvelduspäeva meetod: 2 tööpäeva pärast tehingu kuupäeva

Muutandmed (turutingimustest sõltuvad dünaamilised omadused):

- Tehingu kuupäev: 5. juuni 2014
- Arvelduspäev: 9. juuni 2014 (vastavalt täitmispäeva meetodile)
- Eelmise kupongi kuupäev: 27. aprill 2014
- Järgmise kupongi kuupäev: 27. aprill 2015
- Kogunenud päevade arv: 43 (päevade arv eelmise kupongi kuupäevast arvelduspäevani)
- Alusperiood: 365 (päevade arv eelmise kupongi kuupäevast järgmise kupongi kuupäevani)
- Kogus: 1 000 000 (tehingu nominaal- või rahaline väärtus)
- Puhashind: 98
- Kogunenud intress: 0,26506849 (st $\frac{Nominal\ Coupon}{Annual\ Coupon\ Frequency} \times \frac{Accrued\ Number\ of\ Days}{Period\ Basis} = \frac{2.25}{1} \times \frac{43}{365}$)

Nominal coupon	nominaalkupong

[33] Puhashind = rahavoogudega hind – kogunenud intress
[34] ACT/ACT on ICMA soovitatav meetod võlakirjadele.

Annual Coupon Frequency	kupongi aastasagedus
Accrued Number of Days	kogunenud päevade arv
Period Basis	alusperiood

- Rahavoogudega hind: 98,26506849 (st puhashind + kogunenud intress = 98 + 0,26506849)

Netosumma arvutatakse nii (vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 välja 35 valemile):

Netosumma = (puhashind × nimiväärtus) + (kogunenud kupongid × nimiväärtus), st ($\frac{98}{100}$ × 1 000 000 eurot) + ($\frac{0.26506849}{100}$ × 1 000 000) = 982 650,68 eurot

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘1000000’	<Tx> <New> ... <Tx> … <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>98</Pctg> </Pric> </Pric> <NetAmt>982650.68</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>FR0011637586</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	
33	Hind	‘98’	
35	Netosumma	‘982650.68’	
36	Koht	‘XOFF’	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	

5.35.2.2 Stsenaarium, kus finantsinstrumendi hind on antud diskonteeritud tootluse järgi

93. näide

Investeerimisühing omandab Madalmaade riigikassa võlakirja DTB 0% 12/30/16 (ISIN-kood NL0011923107), kaubeldes hinnaga –0,609%. Tehingu nominaalväärtus on 1 000 000 eurot.

Tehingu netosumma on 1 002 611,97 eurot.

Näite eeldused:

Püsiandmed (mis on määratletud finantsinstrumendi emiteerimisel)

- Tähtpäev: 30. detsember 2016

- Päevaarvestuse meetod: ACT/360
- Arvelduspäeva meetod: 2 tööpäeva pärast tehingu kuupäeva

Muutandmed (turutingimustest sõltuvad dünaamilised omadused):

- Tehingu kuupäev: 27. juuli 2016
- Arvelduspäev: 29. juuli 2016
- Päevi tähtpäevani: 154 (päevade arv arvelduspäevast tähtpäevani)
- Alusperiood: 360 (päevade koguarv vastavalt meetodile)
- Kogus: 1 000 000 (tehingu nominaal- või rahaline väärtus)
- Võlakirja diskonteeritud tootlus: –0,609%
- Puhashind: 100,261197 (st $\frac{100}{1+\frac{Yield}{100} x \frac{Days\ until\ maturity}{Period\ Basis}} = \frac{100}{1+\frac{-0.609}{100} x \frac{154}{360}}$)

Yield	tootlus
Days until maturity	päevi tähtpäevani
Perior Basis	alusperiood

- Rahavoogudega hind: 100,261197 (st puhashind + kogunenud intress = 100,261197 + 0)

Netosumma arvutatakse nii (vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 välja 35 valemile):

Netosumma = (puhashind × nimiväärtus) + (kogunenud kupongid × nimiväärtus), st ($\frac{100.261197}{100}$ x 1 000 000 eurot) + (0 × 1 000 000 eurot) = 1 002 611,97 eurot

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘1000000’	<Tx> <New> … <Tx> … <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Yld>-0.609</Yld> </Pric> </Pric> <NetAmt>1002611.97</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>NL0011923107</Id>
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	
33	Hind	‘–0.609’	
34	Hinna valuuta		
35	Netosumma	‘1002611.97’	
36	Koht	‘XOFF’	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	

			</FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.2.3 Stsenaarium, kus finantsinstrumendi hind (nullkupongiga) on antud võlakirja tootluse järgi

94. näide

Investeerimisühing omandab stripitud FRTR 0% 04/25/2041 (ISIN-kood FR0010773200) börsivälises kauplemises hinnaga 1,06%. Tehingu nominaalväärtus on 1 000 000 eurot.

Tehingu netosumma on 770 343,52 eurot.

Näite eeldused:

Püsiandmed (mis on määratletud finantsinstrumendi emiteerimisel)

- Tähtpäev: 25. aprill 2041
- Kupongi sagedus: puudub
- Päevaarvestuse meetod: ACT/ACT
- Arvelduspäeva meetod: 2 tööpäeva pärast tehingu kuupäeva

Muutandmed (turutingimustest sõltuvad dünaamilised omadused):

- Tehingu kuupäev: 25. juuli 2016
- Arvelduspäev: 27. juuli 2016
- Alusperiood: 365
- Aeg tähtpäevani (arvelduspäevast 27. juulist 2016 kuni tähtpäeva 25. aprillini 2041): „(24 + 272/365) aastat“
- Kogus: 1 000 000 (tehingu nominaal- või rahaline väärtus)
- Stripitud võlakirja tootlus: 1,06%
- Puhashind: 77,0343516 (st $\frac{100}{\left(1+\frac{\text{Yield}}{100}\right)^{\text{Time to maturity}}} = \frac{100}{\left(1+\frac{1.06}{100}\right)^{\left(24+\frac{272}{365}\right)}}$)

Yield	tootlus
Time to maturity	aeg tähtpäevani

- Rahavoogudega hind: 77,0343516 (st puhashind + kogunenud intress = 77,0343516 + 0)

Netosumma arvutatakse nii (vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 välja 35 valemile):

Netosumma = (puhashind × nimiväärtus) + (kogunenud kupongid × nimiväärtus), st ($\frac{77.0343516}{100}$ x 1 000 000 eurot) + (0 × 1 000 000 eurot) = 770 343,52 eurot

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	'1000000'	<Tx> <New> ... <Tx> … <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Yld>1.06</Yld> </Pric> </Pric> <NetAmt>770343.52</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>FR0010773200</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
31	Kogusevaluuta	'EUR'	
33	Hind	'1.06'	
34	Hinna valuuta		
35	Netosumma	'770343.52'	
36	Koht	'XOFF'	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	

5.35.2.4 Vahetusvõlakiri

5.35.2.4.1 Stsenaarium, kus vahetusvõlakirja hind on puhashind

95. näide

Investeerimisühing omandab Vodafone 2% 02/25/2019 (ISIN-kood XS1371473601) börsivälises kauplemises hinnaga 114,00. Tehingu nominaalväärtus on 1 000 000 GBP.

Tehingu netosumma on 1 148 406,59 GBP.

Näite eeldused:

Püsiandmed (mis on määratletud finantsinstrumendi emiteerimisel)

- Tähtpäev: 25. veebruar 2019
- Nominaalkupong: 2%
- Kupongi sagedus: üks kord poolaastas
- Päevaarvestuse meetod: ICMA ACT/ACT

- Arvelduspäeva meetod: 2 tööpäeva pärast tehingu kuupäeva

Muutandmed (turutingimustest sõltuvad dünaamilised omadused):

- Tehingu kuupäev: 25. juuli 2016
- Arvelduspäev: 27. juuli 2016
- Eelmise kupongi kuupäev: 25. veebruar 2016
- Järgmise kupongi kuupäev: 25. august 2017
- Kogunenud päevade arv: 153 (päevade arv eelmise kupongi kuupäevast arvelduspäevani)
- Alusperiood: 182 (päevade arv eelmise kupongi kuupäevast järgmise kupongi kuupäevani)
- Kogus: 1 000 000 (tehingu nominaal- või rahaline väärtus)
- Puhashind: 114,00
- Kogunenud intress: 0,84065934 (st $\frac{\text{Nominal Coupon}}{\text{Annual Coupon Frequency}} \times \frac{\text{Accrued Number of Days}}{\text{Period Basis}} = \frac{2}{2} \times \frac{153}{182}$)

Nominal Coupon	nominaalkupong
Annual Coupon Frequency	kupongi aastasagedus
Accrued Number of Days	kogunenud päevade arv
Period Basis	alusperiood

- Rahavoogudega hind: 114,8406593 (st puhashind + kogunenud intress = 114,00 + 0,84065934)

Netosumma arvutatakse nii (vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 välja 35 valemile):

Netosumma = (puhashind × nimiväärtus) + (kogunenud kupongid × nimiväärtus), st ($\frac{114}{100}$ × 1 000 000 GBP) + ($\frac{0.84065934}{100}$ × 1 000 000 GBP) = 1 148 406,59 GBP

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘1000000’	<Tx> <New> … <Tx> … <Qty> <NmnlVal Ccy="GBP">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>114.00</Pctg> </Pric> </Pric> <NetAmt>1148406.59</NetAmt>
31	Kogusevaluuta	‘GBP’	
33	Hind	‘114.00’	
35	Netosumma	‘1148406.59’	
36	Koht	‘XOFF’	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	

			<TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XS1371473601</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.2.4.2 Stsenaarium, kus finantsinstrumendi hind on kauplemisvaluutas

96. näide

Investeerimisühing omandab 10 000 vahetusvõlakirja CapGemini 0% 1. jaanuaril 2019 (ISIN-kood FR0011600352) börsivälises kauplemises hinnaga 80 eurot. Tehingu netosumma on 800 000 eurot = 10 000 × 80 eurot.

Näite eeldused:

Püsiandmeid (finantsinstrumendi emiteerimisel määratud) ei ole tehinguaruandluseks vaja.

Muutandmed (turutingimustest sõltuvad dünaamilised omadused):

- Kogus: 10 000 (finantsinstrumendi ühikute arv)
- Finantsinstrumendi hind kauplemisvaluutas: 80 eurot

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘10000’	<Tx> <New> ... <Tx> … <Qty> <Unit>10000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">80</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <NetAmt>800000</NetAmt> <TradVn>XOFF</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>FR0011600352</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
31	Kogusevaluuta		
33	Hind	‘80’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
35	Netosumma	‘800000’	
36	Koht	‘XOFF’	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	

5.35.3 Optsioonid

5.35.3.1. Aktsiaoptsioon

97. näide

Investeerimisühing ostab teiselt investeerimisühingult 10 aktsiaostuoptsiooni hinnaga 11,46 eurot lepingu kohta. Kauplemiskohas ostuoptsiooniga ei kaubelda, kuid kaubeldakse selle alusaktsiaga.

Hinnakordaja (alusaktsiate arv ühes lepingus) on 5, täitmishind (hind, millega alusaktsia optsiooni realiseerimisel ostetakse või müüakse) on 70 eurot. Aktsia ISIN on DE0000000001. CFI-kood on HESAVP.

Optsioonilepingu tähtpäev on 31. detsember 2018 ja see arveldatakse füüsiliselt.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘10’	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">11.46</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>EQUITY CALL OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>HESAVP</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>5</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>DE0000000001</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal>
33	Hind	‘11.46’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
51	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘EQUITY CALL OPTION’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘5’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva aktsia {ISIN}	
50	Optsiooni liik	‘CALL’	
51	Täitmishind	‘70’	
52	Täitmishinna valuuta	‘EUR’	
53	Optsiooni täitmise tüüp	‘EURO’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-12-31’	
56	Ülekande liik	‘PHYS’	

			<Amt Ccy="EUR">70</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>PHYS</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.3.2. Börsiväline indeksipõhine optsioonileping

98. näide

Investeerimisühing müüb 50 FTSE 100 indeksi eritellimusel ostuoptsiooni börsivälises kauplemises hinnaga 2 GBP lepingu kohta.

Selle aluseks on FTSE 100 indeks (ISIN: GB0001383545).

Lõpptähtpäev on 14. august 2018. Täitmishind on 3500 ja hinnakordaja on 25. Optsioonileping on Euroopa stiilis ja rahas väljamakstav.

Optsioonilepingu CFI-kood on HEIAVC.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘50’	<Tx> <New> ... <Tx> … <Qty> <Unit>50</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">2</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>HEIAVC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts>
33	Hind	‘2’	
34	Hinna valuuta	‘GBP’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘FTSE 100 INDEX BESPOKE OPTION’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘25’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva indeksi {ISIN}	
48	Aluseks oleva indeksi nimi	{Sisestage indeksi nimi}	
50	Optsiooni liik	‘CALL’	
51	Täitmishind	‘3500’	
53	Optsiooni täitmise tüüp	‘EURO’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-08-14’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			<XpryDt>2018-08-14</XpryDt> <PricMltplr>25</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0001383545</ISIN> <Indx> <Nm> <RefRate> <Nm>FTSE100</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <BsisPts>3500</BsisPts> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.4 Hinnavaheleping

99. näide

Investeerimisühing X kaupleb hinnavahelepinguga (CFD). Aluseks olev Vodafone'i aktsia on reguleeritud turul kaubeldav, kuid hinnavahelepinguga kauplemiskohas ei kaubelda.

Kaubeldavate hinnavahelepingute arv on 10 000. Hinnavahelepingu hind on 3,374 eurot. Alusaktsia (Vodafone) ISIN-kood on GB00BH4HKS39.

Hinnavahelepingu CFI-kood on JESXCC. Hinnakordaja on 1, mis tähendab, et iga hinnavaheleping hõlmab üht aluseks oleva instrumendi ühikut.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	'10000'	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>10000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric>
33	Hind	'3.374'	
34	Hinna valuuta	'EUR'	
36	Koht	'XXXX'	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	'VODAFONE CFD'	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	'1'	

47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva aktsia {ISIN}	<MntryVal> <Amt Ccy="EUR">3.374</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>VODAFONE CFD</FullNm> <ClssfctnTp>JESXCC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB00BH4HKS39</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
56	Ülekande liik	‘CASH’	

5.35.5 Kihlvedu

5.35.5.1 Aktsiakihlvedu

100. näide

Investor kaupleb ühepäevaste aktsiakihlvedudega. Kihlveoga kauplemiskohas ei kaubelda, kuid alusaktsiaga kaubeldakse.

Kihlveo summa on 0,5 GBP hinna iga liikumise kohta väikese vääringuühiku võrra.

Aluseks oleva finantsinstrumendi (ABC PLC) võrdlushind on 102,23 eurot.

Instrumendi täisnimi on vabatekstiväli, mille peab täitma tehingu sooritaja: ABC BET SEP 15 SPREAD. Aktsiakihlveo CFI-kood on JESXSC.

Hinnakordaja on hinna liikumine aluseks oleva instrumendi hinnapunkti võrra: 100, st 1 euro kohta 100 senti. Seega võidavad või kaotavad investorid iga ühesendise liikumise pealt 0,50 GBP.

Alusaktsia ISIN-kood on GB0000000004.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘0.50’	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">0.50</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">102.23</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ABC BET SPREAD</FullNm> <ClssfctnTp>JESXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>100</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000004</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
31	Kogusevaluuta	‘GBP’	
33	Hind	‘102.23’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘ABC BET SPREAD’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘100’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva aktsia {ISIN}	
55	Aegumise kuupäev		
56	Ülekande liik	‘CASH’	

Ühepäevaste kihlvedude korral tuleb esitada aruanne üksnes tehingu algse avamise ja lepingu lõpliku lõpetamise kohta. Tähtpäeva ei märgita.

5.35.5.2 Aktsiafutuuri kihlvedu

101. näide

Tehinguaruande aluseks oleva instrumendi koodi väljale (väli 47) tuleks märkida vahetu aluseks oleva instrumendi ISIN-kood. Selle näite korral on see võlakirjafutuuri, mitte lõpliku aluseks oleva instrumendi (võlakirja) tunnus.

Investor kaupleb ühepäevase kihlveoga võlakirjafutuuri peale, millega kaubeldakse kauplemiskohas.

Kihlveo summa on 2 GBP punkti kohta. Aluseks oleva finantsinstrumendi võrdlushind (baaspunktides) on 9100.

Instrumendi täisnimi on vabatekstiväli, mille peab täitma tehingu sooritaja: ‘Bond Future BET 27MAY15’.

Võlakirjafutuuri kihlveo CFI-kood on JCAXSC.

Hinnakordaja on liikumine aluseks oleva instrumendi hinna ühe punkti suhtes: 1. Aluseks oleva võlakirjafutuuri ISIN-kood on GB1234567891.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘2’	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>9100</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>BOND FUTURE BET 27MAY15</FullNm> <ClssfctnTp>JCAXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB1234567891</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
31	Kogusevaluuta	‘GBP’	
33	Hind	‘9100’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘BOND FUTURE BET 27MAY15’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva futuuri {ISIN}	
55	Aegumise kuupäev		
56	Ülekande liik	‘CASH’	

5.35.5.3 Kihlvedu indeksi peale

102. näide

Investor kaupleb kihlveoga aktsiaindeksi peale, mis koosneb vähemalt ühest kauplemiskohas kauplemisele lubatud finantsinstrumendist. Kihlveoga kauplemiskohas ei kaubelda.

Kihlveo summa on 10 GBP indeksi ühepunktilise liikumise kohta ja aluseks oleva finantsinstrumendi võrdlushind on 9340.

Instrumendi täisnimi on vabatekstiväli, mille peab täitma tehingu sooritaja: FTSE Index BET.

Aktsiaindeksi CFI-kood on JEIXSC.

Kihlveopositsiooni tähtpäev on T + 1, kus T on 27. oktoober 2018.

Hinnakordaja on liikumine indeksi punkti kohta, st 1. Investorid võidavad või kaotavad indeksi iga ühepunktise liikumise pealt 10 GBP.

Indeksi ISIN-kood on GB0001383545.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘10’	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">10</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>9340</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> ... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>FTSE INDEX BET</FullNm> <ClssfctnTp>JEIXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-10-28</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <Indx> <ISIN>GB0001383545</ISIN> <Nm> <RefRate>
31	Kogusevaluuta	‘GBP’	
33	Hind	‘9340’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘FTSE INDEX BET’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva indeksi {ISIN}	
48	Aluseks oleva indeksi nimi	‘FTSE100’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-10-28’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			<Nm>FTSE100</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

5.35.5.4 Kihlvedu organiseeritud kauplemissüsteemis kaubeldava intressiforvardi (FRA) peale

103. näide

Investor sõlmib kihlveo 1-aastase GBP/USD intressiforvardi peale (GBP/USD FRA JUN16). Kihlveoga kauplemiskohas ei kaubelda.

GBP/USD FRA JUN16 hind on 1,5355 (vahetuskurss).

Kihlveo summa on 5 GBP hinna iga liikumise kohta väikese vääringuühiku võrra. Hinnakordaja on hinna liikumine aluseks oleva instrumendi ühe hinnapunkti võrra väikeses vääringuühikus: 100.

GBP/USD FRA JUN16 ISIN on GB0000000006.

GBP/USD FRA kihlveo CFI-kood on JFRXSC.

Intressiforvardi tähtpäev on 30. juuni 2016, mis on ka kihlveo tähtpäev.

Kihlvedu täidetakse sularahas.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘5’	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">5</MntryVal> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="GBP">1.5355</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn>
31	Kogusevaluuta	‘GBP’	
33	Hind	‘1.5355’	
34	Hinna valuuta	‘GBP’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘GBP/USD FRA JUN16 BET’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘100’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva	

		intressi-forvardi {ISIN}	... </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>GBP/USD FRA JUN16 BET</FullNm> <ClssfctnTp>JFRXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-30</XpryDt> <PricMltplr>100</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000006</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
55	Aegumise kuupäev	‘2016-06-30’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

5.35.5.5 Kihlvedu organiseeritud kauplemissüsteemis kaubeldava intressimääraoptsiooni peale

104. näide

Investor sõlmib 6 kuu GBP LIBORi optsiooni peale kihlveo 2 GBP baaspunkti kohta.

6 kuu GBP LIBORi optsiooni väärtus päeval T on 0,71375%. 6 kuu GBP LIBORi optsiooni ISIN on GB0000000007.

GBP LIBORi optsiooni kihlveo CFI-kood on JRMXSC.

GBP LIBORi optsiooni tähtpäev on 17. detsember 2018, mis on ka kihlveo tähtpäev.

Hinnakordaja on 10 000, sest üks baaspunkt on 0,01%. Investor võidab või kaotab iga 0,01% liikumise pealt 2 GBP.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
30	Kogus	‘2’	<Tx> <New> ... <Tx> ... <Qty> <MntryVal Ccy="GBP">2</MntryVal>
31	Kogusevaluuta	‘GBP’	
33	Hind	‘0.71375’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		

42	Instrumendi täisnimi	‘OPTION GBP LIBOR DEC15 BET’	</Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0.71375</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>OPTION GBP LIBOR DEC15 BET</FullNm> <ClssfctnTp>JRMXSC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-17</XpryDt> <PricMltplr>10000</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>GB0000000007</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘10000’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva optsiooni {ISIN}	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-12-17’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

Tehinguaruandesse märgitav aluseks olev instrument on intressimääraoptsiooni leping.

5.35.6 Krediidiriski vahetustehing

105. näide

Investeerimisühing X ostab investeerimisühingult Y börsiväliselt Allianz SE krediidiriski vahetustehingu väärtusega 1 000 000 (üks miljon) eurot ja kupongiga 100 baaspunkti. Krediidiriski vahetustehing täidetakse rahas.

Krediidiriski vahetustehingu tähtpäev on 30. juuli 2020.

Investeerimisühing X saab investeerimisühingult Y ettemakse 33 879 eurot.

Alusvõlakirja ISIN on ZA2344558978 ja sellega kaubeldakse kauplemiskohas. Krediidiriski vahetustehingu CFI-kood on SCUCCC.

Allpool esitatud tehinguaruanne on koostatud üksnes investeerimisühingu X vaatepunktist.

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>100</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> <UpFrntPmt> <Amt Ccy="EUR">33879</Amt> <Sgn>false</Sgn> </UpFrntPmt> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ALLIANZ SE SNR CDS</FullNm> <ClssfctnTp>SCUCCC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2021-06-20</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>ZA2344558978</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ..
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	
30	Kogus	‘1000000’	
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	
33	Hind	‘100’	
36	Koht	‘XXXX’	
38	Ettemakse	‘-33879’	
39	Ettemakse valuuta	‘EUR’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘ALLIANZ SE SNR CDS’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva võlakirja {ISIN}	
55	Aegumise kuupäev	‘2021-06-20’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			</New> </Tx>

Kui ettemakset ei tehta, tuleks väljale 38 märkida ‘0’.

Kui investeerimisühing X on ettemakse saaja, mitte maksja, on väljale 38 märgitava ettemakse väärtus negatiivne.

5.35.7 Vahetuslepingud

Kui tehinguga on seotud mitu rahavoogu ning nende suunda ei saa märkida viitega ostja/müüja väljale, märgitakse see pluss- või miinusmärgiga aluseks oleva instrumendi koodi või aluseks oleva indeksi nime ees. Plussmärk tähendab, et ostja saab aluseks oleva instrumendi (tulemuste) eest, ja miinusmärk, et ostja maksab aluseks oleva instrumendi (tulemuste) eest. Näidete tabelites on kasutatud vahetuslepingu suuna tähistamiseks pluss- ja miinusmärki, kuid XML-is esitatakse need sümbolid XML-siltidena aruande vastava väärtuse (nt aluseks oleva instrumendi koodi) juures. XML-tekstis tähistab plussmärki ‘SwpIn’ ja miinusmärki ‘SwpOut’.

Investeerimisühingutelt eeldatakse pluss- ja miinusmärkide täpset ning järjekindlat kasutamist. Kui vahetuslepingu ostjat või müüjat ei saa tuletada komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 vastavate väljade kirjeldustest, nt kahealuselise aktsia vahetustehingu korral, peaksid välja(de) 47 ja/või 48 pluss- ja miinusmärgid õigesti kajastama, mida tehinguaruandes ostjaks märgitud ühing saab ja mida selles tehinguaruandes müüjaks märgitud ühing maksab.

Ettemakse võidakse teha iga vahetuslepingu korral.

5.35.7.1 Aktsia vahetustehing (ühealuseline)

106. näide

Investeerimisühing X kaupleb investeerimisühinguga Y börsivälise aktsia vahetustehinguga. Alusaktsia on kauplemiskohas kauplemisele lubatud. Ühing X võtab alusaktsia hinnaliikumisega seotud riski ning maksab LIBOR3M pluss 0,05% preemia.

Vahetuslepingu tinglik väärtus on 1 000 000 eurot ja alusaktsia võrdlushind on 50 USD. Vahetusleping lõpeb 31. detsembril 2018 ja see täidetakse rahas.

Instrumendi täisnimi on BAYER EQS LIBOR3M+ 0,05%. Aktsia vahetustehingu CFI-kood on SESPXC.

Alusaktsia on Bayer AG NA (ISIN DE000BAY0017)

Alusintressimäär on LIBOR3M 3,7% + 0,05% tähtajaga 3 kuud.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ...

7	Ostja tunnuskood	Investeerimis ühingu X {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis ühingu Y {LEI}	
30	Kogus	‘1000000’	
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	
33	Hind	‘0.05’	
34	Hinna valuuta		
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘BAYER EQS LIBOR3M+0. 05% SEP 15’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
44	Tinglik valuuta 1	‘EUR’	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	‘+’‘DE000BA Y0017’	
48	Aluseks oleva indeksi nimi	‘-’‘LIBO’	
49	Aluseks oleva indeksi kehtivusaeg	‘3’MNTH’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-12-31’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

```
<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
      ...
      <Buyr>
       <AcctOwnr>
        <Id>
         <LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
       </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
       <AcctOwnr>
        <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>
        </Id>
       </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
      ...
       <Qty>
        <NmnlVal
Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
       </Qty>
       <Pric>
        <Pric>
         <Pctg>0.05</Pctg>
        </Pric>
       </Pric>
       <TradVn>XXXX</TradVn>
      </Tx>
      <FinInstrm>
       <Othr>
        <FinInstrmGnlAttrbts>
         <FullNm>BAYER EQS LIBOR3M+0.05%
SEP 15</FullNm>
         <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp>
         <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
        </FinInstrmGnlAttrbts>
        <DerivInstrmAttrbts>
         <XpryDt>2018-12-31</XpryDt>
         <PricMltplr>1</PricMltplr>
         <UndrlygInstrm>
          <Swp>
           <SwpIn>
            <Sngl>
             <ISIN>DE000BAY0017</ISIN>
            </Sngl>
           </SwpIn>
           <SwpOut>
            <Sngl>
             <Indx>
              <Nm>
               <RefRate>
                <Indx>LIBO</Indx>
               </RefRate>
```

			<Term> <Unit>MNTH</Unit> <Val>3</Val> </Term> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Seejuures tuleb aruandes väljale 30 (kogus) märkida vahetustehingu nimiväärtus. Väljal 46 (hinnakordaja) peab olema tehingu raames kaubeldud vahetuslepingute arv. Väljal 33 (hind) peab olema alusintressimäärale lisaks makstav/saadav preemia, kui seda makstakse/saadakse.

Plussmärk alusinstrumendi koodi ees tähendab, et ostja saab BAYER AG NA tulemuse.

Miinusmärk alusindeksi nime ees tähendab, et ostja tasub intressimäära.

5.35.7.2 Aktsia vahetusleping (kahealuseline), millega kaubeldakse Euroopa Liidu välisel kauplemisplatvormil (instrumenti ei ole ESMA nimekirjas)

<u>107. näide</u>

Investeerimisühing X ostab aktsia vahetuslepingu Euroopa Liidu välisel kauplemisplatvormil, mistõttu see leping ESMA nimekirjas puudub Aluseks olevad aktsiaindeksid sisaldavad finantsinstrumente, mis on lubatud kauplemisele reguleeritud turul.

Kauplemisplatvorm kasutab keskset vastaspoolt, kelle LEI on CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

Vahetuslepingu ISIN on US000DAX000X ja vahetuslepingu tinglik väärtus on 1 000 000 eurot.

Vahetusleping lõpeb 25. juunil 2016 ja see täidetakse rahas.

Üks alusindeks on DAX 30 (ISIN DE0008469008)

Teine alusindeks on IBEX 35 (ISIN ES0SI0000005)

IBEX 35 indeksi võrdlusväärtus on 11 308,40.

Vahetuslepingu riskimarginaal on ‘0’ ja kaks investeerimisühingut lepivad kokku, et ühing X tasub ühingule Y ettemaksena 1000 eurot.

Vahetustehingu koha kood XUSA ja koht kasutab keskset vastaspoolt, kelle LEI on CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC.

Instrumendi täisnimi on vabatekstiväli, mille peab täitma tehingu sooritaja: DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16

Aktsia vahetustehingu CFI-kood on SEIPXC.

Investeerimisühing X saab DAXi tulemuse ja maksab IBEXi tulemuse.

Mis peab olema investeerimisühingute X ja Y aruannetes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Keskse vastaspoole {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
30	Kogus	1000000	1000000
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	‘EUR’
33	Hind	‘0’	‘0’
34	Hinna valuuta		
36	Koht	‘XUSA’	‘XUSA’
38	Ettemakse	‘1000’	‘1000’
39	Ettemakse valuuta	‘EUR’	‘EUR’
41	Instrumendi tunnuskood	{ISIN}	{ISIN}
42	Instrumendi täisnimi	‘DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16’	‘DAX 30 EQS IBEX 35 JUN 16’
43	Instrumendi liigitus	‘SEISPXC’	‘SEISPXC’
44	Tinglik valuuta 1	‘EUR’	‘EUR’
46	Hinnakordaja	‘1’	‘1’
47	Aluseks oleva instrumendi kood	‘+’{DAX 30 ISIN} ‘-’{IBEX 35 ISIN}	‘+’{DAX 30 ISIN} ‘-’{IBEX 35 ISIN}
48	Aluseks oleva indeksi nimi	‘+’‘DAX 30’ ‘-’‘IBEX 35’	‘+’‘DAX 30’ ‘-’‘IBEX 35’
55	Aegumise kuupäev	‘2016-06-25’	‘2016-06-25’
56	Ülekande liik	‘CASH’	‘CASH’

XML:

Investeerimisühingu X aruanne	Investeerimisühingu Y aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr>

```
          <LEI>12345678901234567890</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>

<LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    ...
    <Tx>
    ...
      <Qty>
        <NmnlVal
Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
      </Qty>
      <Pric>
        <Pric>
          <Pctg>0</Pctg>
        </Pric>
      </Pric>
      <TradVn>XUSA</TradVn>
      <UpFrntPmt>
        <Amt Ccy="EUR">1000</Amt>
      </UpFrntPmt>
    </Tx>
    <FinInstrm>
      <Othr>
        <FinInstrmGnlAttrbts>
          <Id>US000DAX000X</Id>
          <FullNm>DAX 30 EQS IBEX 35 JUN
16</FullNm>
          <ClssfctnTp>SEIPXC</ClssfctnTp>
          <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
        </FinInstrmGnlAttrbts>
        <DerivInstrmAttrbts>
          <XpryDt>2016-06-25</XpryDt>
          <PricMltplr>1</PricMltplr>
          <UndrlygInstrm>
            <Swp>
              <SwpIn>
                <Sngl>
                  <Indx>
                    <ISIN>DE0008469008</ISIN>
                    <Nm>
                      <RefRate>
                        <Nm>DAX 30</Nm>
                      </RefRate>
                    </Nm>
                  </Indx>
                </Sngl>
              </SwpIn>
              <SwpOut>
                <Sngl>
```

```
      <AcctOwnr>
        <Id>

<LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Buyr>
    <Sellr>
      <AcctOwnr>
        <Id>

<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI>
        </Id>
      </AcctOwnr>
    </Sellr>
    ...
    <Tx>
    ...
      <Qty>
        <NmnlVal
Ccy="EUR">1000000</NmnlVal>
      </Qty>
      <Pric>
        <Pric>
          <Pctg>0</Pctg>
        </Pric>
      </Pric>
      <TradVn>XUSA</TradVn>
      <UpFrntPmt>
        <Amt Ccy="EUR">1000</Amt>
      </UpFrntPmt>
    </Tx>
    <FinInstrm>
      <Othr>
        <FinInstrmGnlAttrbts>
          <Id>US000DAX000X</Id>
          <FullNm>DAX 30 EQS IBEX 35 JUN
16</FullNm>
          <ClssfctnTp>SEIPXC</ClssfctnTp>
          <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
        </FinInstrmGnlAttrbts>
        <DerivInstrmAttrbts>
          <XpryDt>2016-06-25</XpryDt>
          <PricMltplr>1</PricMltplr>
          <UndrlygInstrm>
            <Swp>
              <SwpIn>
                <Sngl>
                  <Indx>
                    <ISIN>DE0008469008</ISIN>
                    <Nm>
                      <RefRate>
                        <Nm>DAX 30</Nm>
                      </RefRate>
                    </Nm>
                  </Indx>
                </Sngl>
```

<Indx> <ISIN>ES0SI0000005</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>	</SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <Indx> <ISIN>ES0SI0000005</ISIN> <Nm> <RefRate> <Nm>IBEX 35</Nm> </RefRate> </Nm> </Indx> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Alternatiivina võib investeerimisühing Y esitada ka aruande, kus ta märgib investeerimisühingu X asemel ostjaks enda. Sel juhul tuleb aluseks oleva instrumendi välja märke vastavalt muuta, st need peavad näitama, mille (tulemuse) ostja saab ja mille ta peab maksma.

5.35.7.3 Aktsia vahetusleping (kahealuseline), millega kaubeldakse börsiväliselt (instrumenti ei ole ESMA nimekirjas)

108. näide

Investeerimisühing X kaupleb investeerimisühinguga Y börsiväliselt aktsia vahetustehinguga. Alusaktsiad on kauplemiskohas kauplemisele lubatud. Vahetusleping lõpeb 25. juunil 2016 ja see täidetakse rahas. Vahetuslepingu tinglik väärtus on 1 000 000 eurot. Riskimarginaali ei maksta.

Üks alusaktsia on Orange (ISIN FR0000133308).

Teine alusaktsia on Telefonica (ISIN ES0178430E18).

Instrumendi täisnimi on vabatekstiväli, mille peab täitma tehingu sooritaja: ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16. Aktsia vahetustehingu CFI-kood on SESPXC.

Investeerimisühing X saab Orange'i aktsia tulemuse ja maksab Telefonica aktsia tulemuse.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> ...

7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl>
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	
30	Kogus	‘1000000’	
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	
33	Hind	‘0’	
34	Hinna valuuta		
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
44	Tinglik valuuta 1	‘EUR’	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	‘+’{aluseks oleva Orange’i aktsia ISIN} ‘-‘{aluseks oleva Telefonica aktsia ISIN}	
55	Aegumise kuupäev	‘2016-06-25’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			</SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Mis peab olema investeerimisühingu Y aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu Y aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	<Tx> ... <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> <Tx> <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">1000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16</FullNm> <ClssfctnTp>SESPXC</ClssfctnTp> <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy> </FinInstrmGnlAttrbts>
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	
30	Kogus	‘1000000’	
33	Hind		
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘ORANGE EQS TELEFONICA JUN 16’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
44	Tinglik valuuta 1	‘EUR’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	‘+’{aluseks oleva Orange’i aktsia ISIN}‘+’{aluseks oleva Telefonica aktsia ISIN}	
55	Aegumise kuupäev	‘2016-06-25’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			<DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2016-06-25</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Swp> <SwpIn> <Sngl> <ISIN>FR0000133308</ISIN> </Sngl> </SwpIn> <SwpOut> <Sngl> <ISIN>ES0178430E18</ISIN> </Sngl> </SwpOut> </Swp> </UndrlygInstrm> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Alternatiivina võib investeerimisühing Y esitada ka aruande, kus ta märgib investeerimisühingu X asemel ostjaks enda. Sel juhul tuleb aluseks oleva instrumendi välja märke vastavalt muuta, st need peavad näitama, mille (tulemuse) ostja saab ja mille ta peab maksma.

5.35.7.4 Kogutulu vahetusleping, millega kaubeldakse börsiväliselt (instrumenti ei ole ESMA nimekirjas)

109. näide

Investeerimisühing X kaupleb investeerimisühinguga Y börsiväliselt indeksi Austrian Traded Index (ATX) kogutulu vahetuslepinguga. Indeksi ATX ISIN on AT0000999982. Investeerimisühing X maksab fikseeritud intressimäära, mis on määratletud kui EURIBOR 3M pluss 30 baaspunkti, ning investeerimisühing Y maksab indeksi kogutulu, sealhulgas laekumised ja võimaliku kapitalikasvu. Investeerimisühing Y on kogutulu vahetuslepingu müüja ja investeerimisühing Y on kogutulu vahetuslepingu ostja, sest ühing X saab tulu alusvara laekumistest vara ise füüsiliselt omamata, makstes selle eest fikseeritud tasu.

Lepingu tinglik väärtus on 2 000 000 eurot ja tähtpäev 15. detsember 2018.

Kokku lepitud ettemakse on 15 000 eurot, mille investeerimisühing X tasub investeerimisühingule Y. CFI-kood on SEITXC ja leping täidetakse rahas.

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimisühingu X aruandes	Väärtused investeerimisühingu Y aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu Y {LEI}	Investeerimisühingu Y {LEI}
30	Kogus	‘2000000’	‘2000000’

33	Hind	‘30’	‘30’
34	Hinna valuuta		
36	Koht	‘XXXX’	‘XXXX’
38	Ettemakse	‘15000’	‘15000’
39	Ettemakse valuuta	‘EUR’	‘EUR’
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS’	‘TOTAL RETURN SWAP ON ATX AND EURI+30BPS’
43	Instrumendi liigitus	’SEITXC’	’SEITXC’
44	Tinglik valuuta	‘EUR’	‘EUR’
46	Hinnakordaja	‘1’	‘1’
47	Aluseks oleva instrumendi kood	‘+’{aluseks oleva indeksi ATX ISIN}	‘+’{aluseks oleva indeksi ATX ISIN}
48	Aluseks oleva indeksi nimi	‘-’{EURI indeksi nimi}	‘-’ {EURI indeksi nimi}
49	Aluseks oleva indeksi kehtivusaeg	‘3MNTH’	‘3MNTH’
55	Aegumise kuupäev	‘2018-12-15’	‘2018-12-15’
56	Ülekande liik	‘CASH’	‘CASH’

XML:

Ühingu X aruanne	Ühingu Y aruanne
<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>30</BsisPts> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn>	<Tx> <New> ... <ExctgPty>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <NmnlVal Ccy="EUR">2000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <BsisPts>30</BsisPts> </Pric> </Pric>

```
        <UpFrntPmt>
          <Amt Ccy="EUR">15000</Amt>
        </UpFrntPmt>
      </Tx>
      <FinInstrm>
        <Othr>
          <FinInstrmGnlAttrbts>
            <FullNm>TOTAL RETURN SWAP ON
ATX AND EURI+30BPS</FullNm>
            <ClssfctnTp>SEITXC</ClssfctnTp>
            <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
          </FinInstrmGnlAttrbts>
          <DerivInstrmAttrbts>
            <XpryDt>2018-12-15</XpryDt>
            <PricMltplr>1</PricMltplr>
            <UndrlygInstrm>
              <Swp>
                <SwpIn>
                  <Sngl>
                    <Indx>
                      <ISIN>AT0000999982</ISIN>
                      <Nm>
                        <RefRate>

                        </RefRate>
                      </Nm>
                    </Indx>
                  </Sngl>
                </SwpIn>
                <SwpOut>
                  <Sngl>
                    <Indx>
                      <Nm>
                        <RefRate>
                          <Indx>EURI</Indx>
                        </RefRate>
                        <Term>
                          <Unit>MNTH</Unit>
                          <Val>3</Val>
                        </Term>
                      </Nm>
                    </Indx>
                  </Sngl>
                </SwpOut>
              </Swp>
            </UndrlygInstrm>
            <DlvryTp>CASH</DlvryTp>
          </DerivInstrmAttrbts>
        </Othr>
      </FinInstrm>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

```
        <TradVn>XXXX</TradVn>
        <UpFrntPmt>
          <Amt Ccy="EUR">15000</Amt>
        </UpFrntPmt>
      </Tx>
      <FinInstrm>
        <Othr>
          <FinInstrmGnlAttrbts>
            <FullNm>TOTAL RETURN SWAP ON
ATX AND EURI+30BPS</FullNm>
            <ClssfctnTp>SEITXC</ClssfctnTp>
            <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
          </FinInstrmGnlAttrbts>
          <DerivInstrmAttrbts>
            <XpryDt>2018-12-15</XpryDt>
            <PricMltplr>1</PricMltplr>
            <UndrlygInstrm>
              <Swp>
                <SwpIn>
                  <Sngl>
                    <Indx>
                      <ISIN>AT0000999982</ISIN>
                      <Nm>
                        <RefRate>

                        </RefRate>
                      </Nm>
                    </Indx>
                  </Sngl>
                </SwpIn>
                <SwpOut>
                  <Sngl>
                    <Indx>
                      <Nm>
                        <RefRate>
                          <Indx>EURI</Indx>
                        </RefRate>
                        <Term>
                          <Unit>MNTH</Unit>
                          <Val>3</Val>
                        </Term>
                      </Nm>
                    </Indx>
                  </Sngl>
                </SwpOut>
              </Swp>
            </UndrlygInstrm>
            <DlvryTp>CASH</DlvryTp>
          </DerivInstrmAttrbts>
        </Othr>
      </FinInstrm>
      ...
    </New>
  </Tx>
```

5.35.7.5 Aktsiakorvi vahetusleping, millega kaubeldakse börsiväliselt (instrumenti ei ole ESMA nimekirjas)

110. näide

Investeerimisühing X (aktsiate hinna maksja) sõlmib 15. juunil 2018 kaheaastase börsivälise rahas täidetava aktsiakorvi vahetuslepingu investeerimisühinguga Y (fikseeritud intressi maksja) hinnaga 1 aasta LIBOR 3,7% + 5 baaspunkti. Investeerimisühing X nõustub tähtaja lõppedes maksma investeerimisühingule Y neljast aktsiast koosneva aktsiakorvi kogutulemuse (korvi algväärtus: 21,85 eurot). Vahetustehingu esemeks olevate aktsiate arv on 1 000 000, seega on aktsiavahetustehingu tinglik väärtus 21 850 000 eurot.

Korvis on neli aktsiat, millest kolmega kaubeldakse EMP kauplemiskohas:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)
- Cargotec (ISIN FI0009013429)
- Intel Corporation (ISIN US4581401001)

Vastavalt MiFIRi artikli 26 lõike 2 punktile c ei märgita väljale 47 (aluseks oleva instrumendi kood) korvis olevat USA aktsiat, sest sellega EMP kauplemiskohas ei kaubelda.

Lepingu tähtpäev on 15. juuni 2018 ja CFI-kood SEBPXC. Leping täidetakse rahas.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr>
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
30	Kogus	‘21850000’	
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	
33	Hind	‘5’	
34	Hinna valuuta		
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘KOC EQUITY BASKET SWAP JUNE 2018’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
44	Tinglik valuuta 1	‘EUR’	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	‘+‘’ FI0009005870’	

		‘+’ FI0009014575’ ‘+’ FI0009013429’	
48	Aluseks oleva indeksi nimi	‘-’‘LIBO’	
49	Aluseks oleva indeksi kehtivusaeg	‘1YEAR’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-06-15’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

```
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
      ...
       <Qty>
        <NmnlVal
Ccy="EUR">218550000</NmnlVal>
       </Qty>
       <Pric>
        <Pric>
         <BsisPts>5</BsisPts>
        </Pric>
       </Pric>
       <TradVn>XXXX</TradVn>
      </Tx>
      <FinInstrm>
       <Othr>
        <FinInstrmGnlAttrbts>
         <FullNm>KOC EQUITY BASKET
SWAP JUNE 2018</FullNm>
         <ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp>
         <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
        </FinInstrmGnlAttrbts>
        <DerivInstrmAttrbts>
         <XpryDt>2018-06-15</XpryDt>
         <PricMltplr>1</PricMltplr>
         <UndrlygInstrm>
          <Swp>
           <SwpIn>
            <Bskt>
             <ISIN>FI0009005870</ISIN>
             <ISIN>FI0009014575</ISIN>
             <ISIN>FI0009013429</ISIN>
            </Bskt>
           </SwpIn>
           <SwpOut>
            <Sngl>
             <Indx>
              <Nm>
               <RefRate>
                <Indx>LIBO</Indx>
               </RefRate>
               <Term>
                <Unit>YEAR</Unit>
                <Val>1</Val>
               </Term>
              </Nm>
             </Indx>
            </Sngl>
           </SwpOut>
          </Swp>
         </UndrlygInstrm>
         <DlvryTp>CASH</DlvryTp>
        </DerivInstrmAttrbts>
       </Othr>
      </FinInstrm>
      ...
```

			</New> </Tx>

Praegusel juhul on aktsiakorvi vahetuslepingu ostjaks investeerimisühing Y, sest investeerimisühing Y saab aktsiakorvi tulemuse.

5.35.7.6 Börsiväline kahe korvi vahetusleping (instrumenti ei ole ESMA nimekirjas)

111. näide

Investeerimisühing X (korvi A tulemuse maksja) sõlmib 15. juulil 2018 kaheaastase rahas täidetava börsivälise aktsiakorvide vahetuslepingu investeerimisühinguga Y (korvi B tulemuse maksja). Investeerimisühing X nõustub tähtaja lõppedes maksma aktsiakorvi A kogutulemuse ja investeerimisühing Y nõustub tähtaja lõppedes maksma aktsiakorvi B kogutulemuse. Aktsiavahetuslepingu tinglik väärtus on 10 000 000 eurot.

Aktsiakorvis A on kaks aktsiat (millega kaubeldakse kauplemiskohas) võrdlusväärtusega 16,10 eurot:

- Konecranes (ISIN FI0009005870)
- Outotec (ISIN FI0009014575)

Aktsiakorvis B on kaks aktsiat (millega kaubeldakse kauplemiskohas) võrdlusväärtusega 40,85 eurot:

- Elisa (ISIN FI0009007884)
- TeliaSonera (ISIN SE0000667925)

Vahetuslepingu tähtpäev on 15. juuli 2018 ja CFI-kood SEBPXC.

Vahetuslepingu riskimarginaal on ‘0’.

Alljärgnevad tehinguaruanded kajastavad üksnes investeerimisühingu X vaatepunkti.

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ...
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ...
30	Kogus	‘10000000’	
31	Kogusevaluuta	‘EUR’	<Buyr> <AcctOwnr> <Id>
33	Hind	‘0’	
34	Hinna valuuta		
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id>

42	Instrumendi täisnimi	‘RELATIVE PERFORMANCE SWAP XXX JULY 2018’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
44	Tinglik valuuta 1	‘EUR’	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	”+”FI0009007884 ”+” SE0000667925 ”-”FI0009005870 ”-”FI0009014575’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-07-15’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

```
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <LEI>12345678901234567890</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      ...
      <Tx>
      ...
        <Qty>
          <NmnlVal
Ccy="EUR">10000000</NmnlVal>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <Pctg>0</Pctg>
          </Pric>
        </Pric>
        <TradVn>XXXX</TradVn>
      </Tx>
      <FinInstrm>
        <Othr>
          <FinInstrmGnlAttrbts>
            <FullNm>RELATIVE
PERFORMANCE SWAP XXX JULY
2018</FullNm>
            <ClssfctnTp>SEBPXC</ClssfctnTp>
            <NtnlCcy>EUR</NtnlCcy>
          </FinInstrmGnlAttrbts>
          <DerivInstrmAttrbts>
            <XpryDt>2018-07-25</XpryDt>
            <PricMltplr>1</PricMltplr>
            <UndrlygInstrm>
              <Swp>
                <SwpIn>
                  <Bskt>
                    <ISIN>FI0009007884</ISIN>
                    <ISIN>SE0000667925</ISIN>
                  </Bskt>
                </SwpIn>
                <SwpOut>
                  <Bskt>
                    <ISIN>FI0009005870</ISIN>
                    <ISIN>FI0009014575</ISIN>
                  </Bskt>
                </SwpOut>
              </Swp>
            </UndrlygInstrm>
            <DlvryTp>CASH</DlvryTp>
          </DerivInstrmAttrbts>
        </Othr>
      </FinInstrm>
      ...
    </New>
```

			</Tx>

Kui investeerimisühing Y esitab aruande, kus ta märgib investeerimisühingu X asemel ostjaks enda, tuleb aluseks oleva instrumendi välja märke vastavalt muuta, st need peavad näitama, mille (tulemuse) ostja saab ja mille ta peab maksma.

5.35.7.7 Lihtne intressimäära vahetusleping, millega kaubeldakse kauplemiskohas (instrument on ESMA nimekirjas)

112. näide

Investeerimisühing X ostab investeerimisühingult Y kauplemiskohas M lihtsa intressimäära vahetuslepingu (ISIN XS0000000003) tingliku väärtusega 100 000 000 GBP. Vahetuslepingu tähtpäev on 21. oktoober 2025. Lihtsuse huvides eeldame, et vahetuslepingu riskimarginaal on null.

Investeerimisühing X maksab 1,8655% poolaastas (Act/365F) ning investeerimisühing Y maksab 6 kuu GBP LIBORi poolaastas (Act/365F).

Vahetuslepingu riskimarginaal on ‘0’.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> … <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> <Qty>
7	Ostja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu Y {LEI}	
30	Kogus	‘100000000’	
31	Kogusevaluuta	‘GBP’	
33	Hind	‘0’	
34	Hinna valuuta		
36	Koht	Kauplemiskoha M segmendi {MIC}	
41	Instrumendi tunnuskood	Instrumendi {ISIN}	

			<NmnlVal Ccy="GBP">100000000</NmnlVal> </Qty> <Pric> <Pric> <Pctg>0</Pctg> </Pric> </Pric> <TradVn>XMIC</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>XS0000000003</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>

Hind väljal 33 peab vastama fikseeritud väärtusele, mis on märgitud instrumentide võrdlusandmestikus.

5.35.8 Kauba tuletisinstrumendid

5.35.8.1 Börsiväline optsioon börsil kaubeldavale kaubafutuurile

113. näide

Investeerimisühing X ostab 100 kindlaksmääratud hinnataseme ületamisel jõustuvat Ameerika barjääriga ostuoptsiooni maisifutuuridele. Täitmishind on 168 eurot ja tähtpäev on 30. august 2018. Üks optsioonileping annab ostjale õiguse ühele maisifutuurile.

Makstav preemia on 0,95 eurot.

Barjääriga optsioonilepingu aluseks on futuur, millega kaubeldakse Pariisi Euronextil hinnaga 170 eurot. Maisifutuuri kauplemisühik on 50 tonni ja lepingu ISIN on FR0000000000.

Barjääriks määratakse 172 eurot (optsioonileping jõustub ainult siis, kui alusfutuuri hind jõuab barjäärini).

Barjääriga optsiooni CFI-kood on HTFBBC ja leping täidetakse rahas.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>
30	Kogus	‘100’	
33	Hind	‘0.95’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
36	Koht	‘XXXX’	

41	Instrumendi tunnuskood		... <Tx> ... <Qty> <Unit>100</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">0.95</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>UP AND IN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORN FUTURES CONTRACT</FullNm> <ClssfctnTp>HTFBBC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-08-30</XpryDt> <PricMltplr>1</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>FR0000000000</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">168</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>AMER</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
42	Instrumendi täisnimi	‘UPANDIN BARRIER OPTION ON EURONEXT CORNFUTURES CONTRACT’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘1’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Maisifutuuri {ISIN}	
50	Optsiooni liik	‘CALL’	
51	Täitmishind	‘168’	
52	Täitmishinna valuuta	‘EUR’	
53	Optsiooni täitmise tüüp	‘AMER’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-08-30’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

Barjääriga optsiooni alusinstrumendiks on maisifutuur, mistõttu väljale 47 märgitakse Euronexti maisifutuuri tunnus.

Barjääriga optsiooni kirjeldavad tehinguaruandes instrumendi võrdlusandmete väljad.

5.35.8.2 Saastekvoodi leping

114. näide

Investeerimisühing X ostab 3000 Euroopa Liidu saastekvooti reguleeritud turult European Energy Exchange (MIC XEEE) hinnaga 7,50 eurot.

Instrumendi ISIN on DE000A1DKQ99.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>3000</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.50</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A1DKQ99</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
30	Kogus	‘3000’	
33	Hind	‘7.50’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
36	Koht	Kauplemiskoha segmendi {MIC}	
41	Instrumendi tunnuskood	Saastekvoodi lepingu {ISIN}	

5.35.8.3 Saastekvoodifutuur

115. näide

Investeerimisühing X ostab 5 Euroopa Liidu saastekvoodi futuuri (1 futuur sisaldab 1000 Euroopa Liidu CO_2 ühikut) reguleeritud turult European Energy Exchange (MIC XEEE) hinnaga 7,90 eurot.

Saastekvoodifutuuri ISIN on DE000A0SYVA6.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">7.90</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEEE</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE000A0SYVA6</Id> </FinInstrm> ... </New> </Tx>
30	Kogus	‘5’	
33	Hind	‘7.90’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
36	Koht	Kauplemiskoha segmendi {MIC}	
41	Instrumendi tunnuskood	Futuurlepingu {ISIN}	

5.35.8.4 Börsiväline optsioon börsil kaubeldavale saastekvoodifutuurile

116. näide

Investeerimisühing X ostab börsiväliselt 5 Euroopa-tüüpi ostuoptsiooni börsil kaubeldavale saastekvoodifutuurile. Makstav preemia on 1,00 eurot ja optsiooni tähtpäev on 31. detsember 2018. Selle optsiooniga ei kaubelda kauplemiskohas ja sel puudub ISIN-kood.

Hinnakordaja (alusfutuuride arv lepingus) on 10 ning täitmishind (hind, millega futuur optsiooni realiseerimisel ostetakse või müüakse) on 8,00 eurot.

Saastekvoodifutuuriga kaubeldakse reguleeritud turul European Energy Exchange (MIC XEEE) ja selle ISIN-kood on DE000A0SYVA6.

Ostuoptsiooni CFI-kood on HTFAV ja leping täidetakse rahas.

Mis peab olema investeerimisühingu X aruandes?

Nr	Andmeväli	Väärtused investeerimis-ühingu X aruandes	XML
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	<Tx> <New> ... <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>5</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">1.00</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XXXX</TradVn> </Tx> <FinInstrm> <Othr> <FinInstrmGnlAttrbts> <FullNm>XXX CALL OPTION</FullNm> <ClssfctnTp>HTFAVC</ClssfctnTp> </FinInstrmGnlAttrbts> <DerivInstrmAttrbts> <XpryDt>2018-12-31</XpryDt> <PricMltplr>10</PricMltplr> <UndrlygInstrm> <Othr> <Sngl> <ISIN>DE000A0SYVA6</ISIN> </Sngl> </Othr> </UndrlygInstrm> <OptnTp>CALL</OptnTp> <StrkPric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">8.00</Amt> </MntryVal> </Pric> </StrkPric> <OptnExrcStyle>EURO</OptnExrcStyle> <DlvryTp>CASH</DlvryTp> </DerivInstrmAttrbts> </Othr>
30	Kogus	‘5’	
33	Hind	‘1.00’	
34	Hinna valuuta	‘EUR’	
36	Koht	‘XXXX’	
41	Instrumendi tunnuskood		
42	Instrumendi täisnimi	‘XXX CALL OPTION’	
43	Instrumendi liigitus	{CFI-kood}	
46	Hinnakordaja	‘10’	
47	Aluseks oleva instrumendi kood	Aluseks oleva futuuri {ISIN}	
50	Optsiooni liik	‘CALL’	
51	Täitmishind	‘8.00’	
52	Täitmishinna valuuta	‘EUR’	
53	Optsiooni täitmise tüüp	‘EURO’	
55	Aegumise kuupäev	‘2018-12-31’	
56	Ülekande liik	‘CASH’	

			</FinInstrm> ... </New> </Tx>

Ostuoptsiooni alusinstrumendiks on saastekvoodifutuur, mistõttu väljale 47 märgitakse selle futuuri ISIN.

5.35.9 Komplekstehingud

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklit 12 kohaldatakse üksnes siis, kui investeerimisühing sooritab vähemalt kaht finantsinstrumenti hõlmava tehingu (komplekstehingu). See tähendab, et tehinguaruandluses tuleks vähemalt kaht finantsinstrumenti hõlmavaks lugeda üksnes tehing, mille raames kaubeldakse mitme finantsinstrumendiga samal ajal ning ühtse hinnaga (nt erinevaid ostuoptsioone sisaldava „lühikeseks müügi liblikalepingu“ ost). Kõik näites esitamata väljad (nt strateegiad ja struktureeritud tooted) tuleb täita komplekstehingu, mitte tegelike alustehingute andmetega.

117. näide

Investeerimisühing X soovib luua lühikeseks müügi liblikastrateegia, mis koosneb kahest väljakirjutatud ostuoptsioonist 1075 finantsinstrumendile ja ühest ostetud ostuoptsioonist 2150 finantsinstrumendile. Ta sisestab kaks müügikorraldust ja ühe ostukorralduse Eurexi kauplemissüsteemi, kus need täidetakse ühe strateegiatehinguna ühtse hinnaga.

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes	Väärtused 3. aruandes
2	Tehingu viitenumber	89127	89128	89129
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Keskse vastaspoole {LEI}	Ühingu X {LEI}	Keskse vastaspoole {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimis-ühingu X {LEI}	Keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimis-ühingu X {LEI}
30	Kogus	‘1075’	‘2150’	‘1075’
33	Hind	‘40’	‘40’	‘40’
36	Koht	Kauplemiskoha segmendi {MIC}	Kauplemiskoha segmendi {MIC}	Kauplemiskoha segmendi {MIC}
40	Komplekstehingu osa tunnus	‘12345’	‘12345’	‘12345’

XML:

1. aruanne	2. aruanne	3. aruanne
<Tx> <New> <TxId>89127</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>	<Tx> <New> <TxId>89128</TxId>	<Tx> <New> <TxId>89129</TxId> <ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty>

<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>1075</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="…">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx>	<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty> <Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>2150</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="…">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx>	<Buyr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Buyr> <Sellr> <AcctOwnr> <Id> <LEI>12345678901234567890</LEI> </Id> </AcctOwnr> </Sellr> ... <Tx> ... <Qty> <Unit>1075</Unit> </Qty> <Pric> <Pric> <MntryVal> <Amt Ccy="…">40</Amt> </MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpntId> </Tx> ... </New> </Tx>

118. näide

Investeerimisühing X müüb 10 võlakirjafutuuri Eurexi võlakirjaturul (XEUR) ja ostab samal ajal vastava arvu aluseks olevaid Saksamaa riigivõlakirju. Need tehinguetapid moodustavad osa strateegiatehingust (aluskauplemine) ning kaubeldakse ühtse hinnaga 20 eurot.

Aluseks oleva võlakirjafutuuri ISIN-kood on DE0000000000 ja aluseks oleva võlakirja ISIN-kood on DE0000000001.

Selle tehingu kohta tuleks esitada kaks eraldi tehinguaruannet, millest kumbki kajastab tehingut ühe strateegia osaks oleva finantsinstrumendiga. Mõlemad tehinguaruanded tuleb seostada väljale 40 märgitava seosekoodiga, mis on kordumatu ja ühe strateegiaga seotud tehinguaruannete korral sama.

Allpool esitatud tehinguaruanded kajastavad üksnes investeerimisühingu X vaatepunkti.

Nr	Andmeväli	Väärtused 1. aruandes	Väärtused 2. aruandes
4	Sooritava isiku tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
7	Ostja tunnuskood	Keskse vastaspoole {LEI}	Investeerimisühingu X {LEI}
16	Müüja tunnuskood	Investeerimisühingu X {LEI}	Keskse vastaspoole {LEI}
30	Kogus	‘10’	‘1000000’
33	Hind	‘20’	‘20’
34	Hinna valuuta	‘EUR’	‘EUR’
36	Koht	Kauplemiskoha segmendi {MIC}	Kauplemiskoha segmendi {MIC}
40	Komplekstehingu osa tunnus	‘12345’	‘12345’
41	Instrumendi tunnuskood	{Võlakirjafutuuri ISIN}	{Võlakirja ISIN}

XML:

1. aruanne

```
<Tx>
    <New>
    ...

<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty
>
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <LEI>12345678901234567890</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      …
      <Tx>
        …
        <Qty>
          <Unit>10</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="EUR">20</Amt>
```

2. aruanne

```
<Tx>
    <New>
    ...

<ExctgPty>12345678901234567890</ExctgPty
>
      <Buyr>
        <AcctOwnr>
          <Id>
            <LEI>12345678901234567890</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Buyr>
      <Sellr>
        <AcctOwnr>
          <Id>

<LEI>CCPCCPCCPCCPCCPCCPCC</LEI>
          </Id>
        </AcctOwnr>
      </Sellr>
      …
      <Tx>
        …
        <Qty>
          <Unit>1000000</Unit>
        </Qty>
        <Pric>
          <Pric>
            <MntryVal>
              <Amt Ccy="EUR">20</Amt>
```

</MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpntId> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE0000000000</Id> </FinInstrm> … </New> </Tx>	</MntryVal> </Pric> </Pric> <TradVn>XEUR</TradVn> <CmplxTradCmpntId>12345</CmplxTradCmpntId> </Tx> <FinInstrm> <Id>DE0000000001</Id> </FinInstrm> … </New> </Tx>

6 Korralduste arvestuse pidamise suunised

I osa. Üldpõhimõtted

6.1 Korralduste arvestuse pidamise nõuete kohaldamisala

Vastavalt artikli 25 lõikele 2 kohaldatakse korralduste arvestuse pidamise nõudeid kauplemiskohtade korraldajatele „kõigi nende süsteemide kaudu teatavaks tehtavate finantsinstrumentide korralduste“ suhtes.

Neid kohaldatakse korralduste suhtes, sealhulgas aktiivsete, mitteaktiivsete, peatatud, kaudsete ja ümbersuunatud korralduste ning korralduste muudatuste, tühistamiste ja tagasilükkamiste suhtes. Neid kohaldatakse ka kindlatele ja indikatiivsetele pakkumistele.

6.2 Kauplemiskoha liikmed või osalised

MiFID II ja MiFIR sisaldavad mitut sätet, milles mainitakse kauplemiskoha liiget või osalist. Kauplemiskoht on määratletud MiFID II artikli 4 lõike 1 punktis 24 ning see hõlmab reguleeritud turge, mitmepoolseid kauplemissüsteeme ja organiseeritud kauplemissüsteeme. Sellegipoolest on vaja täiendavalt selgitada, mida tähendab MiFID II artiklis 50 ja MiFIRi artikli 25 lõikes 2 kauplemiskoha „liige või osaline“.

Mõisteid „liige“ ja „osaline“ kasutatakse üldiselt reguleeritud turgude ning mitmepoolsete kauplemissüsteemide kontekstis. MiFID II põhjenduses 16 selgitatakse: „Reguleeritud turgudele või mitmepoolsetesse kauplemissüsteemidesse juurdepääsu omavatele isikutele osutatakse kui liikmetele või osalistele. Nimetatud mõisted on teineteisega asendatavad. […]“

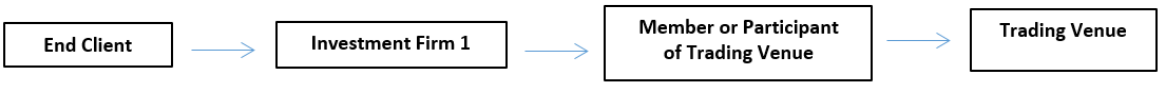
Samas kasutatakse organiseeritud kauplemissüsteemide korral teistsugust metoodikat, sest organiseeritud kauplemissüsteemide korraldajatele kohaldatakse MiFIDi kliendipoole kohustusi, kuid mitmepoolsete kauplemissüsteemide ja reguleeritud turgude korraldajatele mitte. Näiteks on MiFID II artikli 18 lõikes 7 sätestatud, et mitmepoolsetel ja organiseeritud kauplemissüsteemidel peaks olema „vähemalt kolm olulisel määral aktiivset liiget või kasutajat“. Samas keelab MiFID II artikkel 20 organiseeritud kauplemissüsteemil täita „klientide“ korraldusi organiseeritud kauplemissüsteemi oma kapitali arvel. Mõlemal juhul nähtub, et mõisteid „kasutaja“ ja „klient“ on organiseeritud

kauplemissüsteemi puhul kasutatud teineteisega asendatavana, seega on need „liikme“ ja „osalise“ mõistetega analoogsed.

Et organiseeritud kauplemissüsteemid kuuluvad turukuritarvituste määruse kohaldamisalasse ning MiFID II / MiFIRi nõudeid tuleb kohaldada eri kauplemiskohtade suhtes järjekindlalt, tuleb ka organiseeritud kauplemissüsteemide kliendid või kasutajad lugeda komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 (tehinguandmete säilitamine) ja komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 (kellade sünkroonimine) mõistete „liige või osaline“ alla kuuluvaks.

6.3 Kliendi tunnuskood (väli 3)

Kliendi tunnuskoodiga (väli 3) identifitseeritakse liige või osalise klient. Väljale 3 tuleks märkida vastavalt üksnes kauplemiskoha liikme või osalise vahetu kliendi LEI või {RIIKLIK_TUNNUS}. Kliendi tunnuskoodi (väli 3) säilitamine ei kohusta kauplemiskohti salvestama lõppkliendi tunnust ega muid vahendajate klienditunnuseid ahelas, mis kulgeb liikme või osalise vahetust kliendist lõppkliendini. Seda selgitust illustreerib alljärgnev vooskeem, kus kauplemiskoha liikme või osalise kliendiks on investeerimisühing 1.



End client	Lõppklient
Investment Firm 1	Investeerimisühing 1
Member of Participant of Trading Venue	Kauplemiskoha liige või osaline
Trading Venue	Kauplemiskoht

Kauplemiskohtade korraldajad peavad küsima vahetu kliendi tunnuse oma liikmelt või osaliselt ning märkima selle klienditunnuse väljale 3.

Kui klienditunnust ei esitata kauplemiskoha korraldajale korralduse esitamisel, peaks korraldaja hankima puuduva klienditunnuse niipea kui võimalik, kuid hiljemalt korralduse esitamisele järgneva tööpäeva lõpuks.

Kauplemiskoht peaks klientide korral kontrollima, et esitatud tunnuskoodis ei oleks ilmseid vigu ega puudusi.

6.3.1 Väljale 3 (kliendi tunnuskood) täitmine koondkorralduste korral

Kui jaotamine on toimunud ja kliendid on enne korralduse kauplemiskoha liikmele või osalisele täitmiseks esitamist identifitseeritud, kuid kauplemiskoha liige või osaline koondab korraldused, tuleb kauplemiskoha korraldajal märkida väljale 3 vaikimisi viide „AGGR“.

6.3.2 Välja 3 (kliendi tunnuskood) täitmine, kui jaotamist ei ole veel toimunud

Erandjuhul, kui jaotamist ei ole korralduse esitamise ajaks veel toimunud ning kui kohaldatavad riiklikud õigusaktid lubavad korraldust jagada pärast selle esitamist, tuleb kauplemiskoha korraldajal sellise korralduse korral märkida väljale 3 vaikimisi viide „PNAL“. Vastava kauplemiskoha korraldaja ei pea hiljem hankima kliendi tunnust ajal, mil korraldusi üksikutele klientidele jaotatakse.

6.4 Mittesooritav maakler (väli 6)

Mittesooritava maakleri tegevus erineb otsese elektroonilise juurdepääsu pakkumisest, nagu see on määratletud MiFID II artikli 4 lõike 1 punktis 41. Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 artikli 2 lõike 1 punktis d koos väljaga 6 sätestatakse, et sellise teenusega on tegu siis, kui kauplemiskoha liige või osaline (mittesooritav maakler) suunab kauplemiskohta korralduse kauplemiskoha teise liikme või osalise eest ja nimel.

119. näide

Investeerimisühing X esitab kliendi Z nimel kauplemiskohale M täitmiseks korralduse mittesooritava maakleri, investeerimisühingu Y kaudu.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	Kauplemiskoha M liikme investeerimisühingu X {LEI}	
2	Otsene elektrooniline juurdepääs	FALSE	
3	Kliendi tunnuskood	Füüsilise isiku Z {RIIKLIK_TUNNUS}	
6	Tehinguid mittetäitev maakler	Investeerimisühingu Y {LEI}	
B jagu – kauplemisvolitused ja likviidsuse pakkumine			
7	Kauplemisvolitused	AOTC	Investeerimisühing X tegutseb kliendi Z nimel

6.5 Korralduse seisund (väli 33)

Tühistamise, tagasilükkamise, aegumise ja lõpuni täidetud toimingute korral peaks korralduse seisundi väli olema tühi, sest need ei asu enam kauplemiskoha tellimusraamatus.

6.6 Kehtivuse kuupäev ja aeg (väli 12)

i. Viivitamata täitmiseks ette nähtud ja täida-või-tühista-korralduste korral tuleks väli 12 (kehtivuse kuupäev ja aeg) jätta tühjaks (vt väli 10 – kehtivusaeg). Põhjus on, et need

korralduste liigid on ette nähtud täitmiseks kohe pärast tellimusraamatusse sisestamist (täida-või-tühista-korralduste korral täielikult ja viivitamata täitmiseks ette nähtud korralduste korral suurimas võimalikus mahus).

ii. Kategooria „Muu“ korral tähistab viide „muude“ kehtivusaegade kuupäeva- ja kellaajatemplitele mis tahes muud kehtivusaega, mida ei ole väljal 10 (kehtivusaeg) eraldi loetletud. Sel juhul tuleks väljale 10 märkida seda konkreetset kehtivusaja liiki tähistav kordumatu neljatäheline kood ja täita väli 12.

6.7 Passiivsus- või agressiivsusnäitaja (väli 44)

See väli tuleks täita üksnes pidevkauplemise etappidel toimuvate soorituste korral, muul juhul jätta tühjaks. Põhjus on, et oksjoniperioodidel ei saa korraldus olla ei passiivne ega agressiivne.

6.8 Kauplemiskoha tehingu tunnuskood (väli 48)

Vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 artiklile 12 peavad kauplemiskohtade korraldajad määrama unikaalse „kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi“ (TVTIC) igale tehingule, mille aluseks on korralduse täielik või osaline täitmine vastavalt väljal 48 märgitule.

Seetõttu peaksid kauplemiskohtade korraldajad alati genereerima kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi igale nende kauplemiskohas sooritatud tehingule, mille aluseks on nende süsteemide kaudu teatavaks tehtud finantsinstrumendiga seotud korraldus. Sellistel juhtudel peaks kauplemiskoha korraldaja aruandes esitama vastava kauplemiskoha tehingu tunnuskoodi, märkides selle väljale 48.

6.9 Järjenumber (väli 15)

Järjenumbriga määratakse, mis sündmus toimus kauplemiskohas esimesena, kui kahel sündmusel on sama ajatempel. Kauplemiskohad peaksid tagama, et igale konkreetsele väljal 21 sisu ja vormingu veergudes loetletud sündmusele on määratud järjenumber. Punktis 6.13.9 loetletud kauplemisetapid kuuluvad väljal 21 loetletud sündmuse „seisundi muutmine turutoimingute poolt“ alla. Seetõttu peaksid kauplemiskohad kauplemisetappide vaheldumise korral märkima järjenumbri.

Mõningad kauplemiskohad võivad oma süsteemide koormuste tasakaalustamiseks kasutada mitut sobitamissüsteemi. Sel juhul peab iga sündmuse järjenumber olema kordumatu ning selles sobitamissüsteemis kõigi sündmuste korral järjepidev.

Allpool on järgmised näited:

i) vale kasutusviis, kus järjenumber esineb ainult ühes tellimusraamatus;

ii) vale kasutusviis, kus igal korraldusel näib olevat kordumatu järjenumber;

iii) järjenumbri õige kasutusviis.

Allpool 77. ja 78. näites sisaldab kauplemiskoha üks sobitamissüsteem mitut tellimusraamatut ning kummaski tellimusraamatus toimub mitu sündmust.

120. näide: vale kasutusviis, kus järjenumber esineb ainult ühes tellimusraamatus;

Käesoleval juhul näib, et järjenumber esineb ainult ühes tellimusraamatus. See ei ole vastuvõetav, sest tähendab, et pädevad asutused ei saa konsolideerida sama sobitamissüsteemi mitmes tellimusraamatus toimuvaid sündmusi, näiteks konsolideerida sama finantsinstrumendiga seotud sündmusi avalikes ja varjatud raamatutes.

Õiged järjenumbrid peaksid olema 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7.

Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine (väli 21)	Tellimus-raamatu tunnuskood (väli 17)	Korralduse tunnuskood (väli 20)	Järjenumber (väli 15)	Kuupäev ja kellaaeg
NEWO	1. tellimus-raamat	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z
NEWO	2. tellimus-raamat	GHI	1	2018-03-07T08:30:26.548936Z
CHME	1. tellimus-raamat	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z
NEWO	2. tellimus-raamat	TUV	2	2018-03-07T08:30:26.598731Z
NEWO	1. tellimus-raamat	DEF	3	2018-03-07T08:30:26.975621Z
CAME	1. tellimus-raamat	ABC	4	2018-03-07T08:30:27.025489Z
CAME	1. tellimus-raamat	DEF	5	2018-03-07T08:30:27.025489Z

121. näide: vale kasutusviis, kus igal korraldusel näib olevat kordumatu järjenumber;

Käesoleval juhul näib, et igal korraldusel on kordumatu järjenumber, mitte sobitamissüsteemis kõikjal sama.

Õiged järjenumbrid peaksid olema 1, 2, 3, 4, 5.

Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine (väli 21)	Korralduse tunnuskood (väli 20)	Järjenumber (väli 15)	Kuupäev ja kellaaeg (väli 9)	Märkus
NEWO	ABC	1	2018-03-07T08:30:26.548921Z	Järjenumber on seotud üksnes korraldusega, seega suurendab iga selle korraldusega seotud sündmus järjenumbrit. See ei ole õige, sest iga sündmuse järjenumber peaks olema kordumatu ja kõigi sündmuste korral järjepidev.
CHME	ABC	2	2018-03-07T08:30:26.598721Z	
NEWO	DEF	1	2018-03-07T08:30:26.975621Z	Et tegu ei ole sama korraldusega, algavad järjenumbrid uuesti ühest.
CAME	ABC	3	2018-03-07T08:30:27.025489Z	
CAME	DEF	2	2018-03-07T08:30:27.025489Z	Ajatempel on sama kui eelmisel sündmusel. Kui aga pädevad asutused sordiksid järjenumbreid kasvavas järjestuses, jätaks see mulje, et see sündmus toimus enne sellest vahetult ülalpool olevat sündmust, mis ei ole tõsi.

122. näide: järjenumbri õige kasutusviis.

Käesoleva näite korral eeldatakse, et kõik sündmused toimuvad samas tellimusraamatus ja kauplemiskohal on üks sobitamissüsteem.

Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine (väli 21)	Korralduse tunnuskood (väli 20)	Järjenumber (väli 15)	Kuupäev ja kellaaeg (väli 9)	Märkus
NEWO	ABC	25897	2018-03-07T08:30:26.548921Z	Järjenumber genereeritakse kauplemiskoha kõigis tellimus-raamatutes. Seega võib järjenumber ühe tellimus-raamatu sündmusi vaadates suureneda rohkem kui 1 võrra.
CHME	ABC	26589	2018-03-07T08:30:26.598721Z	Järjenumber on suurenenud rohkem kui 1 võrra, sest sobitamissüsteem on töödel-nud teiste tellimusraamatute teisi sündmusi, kuid on siiski kordumatu positiivne arv kasvavas järjestuses.
NEWO	DEF	26751	2018-03-07T08:30:26.975621Z	
CAME	ABC	27465	2018-03-07T08:30:27.025489Z	
CAME	DEF	27466	2018-03-07T08:30:27.025489Z	Ajatempel on sama kui eelmisel sündmusel. Samas võimaldab järjenumber pädeval asutusel kindlaks teha, kas see sündmus toimus pärast eelmise rea sündmust.

6.10 Kehtivusaeg (väli 10)

6.10.1 Päeva jooksul kehtivuse (DAVY) indikaator

123. näide

Investeerimisühing X esitab kauplemiskohale M 16. jaanuaril 2018 täitmiseks päeva jooksul kehtivuse indikaatoriga (DAVY) korralduse.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
10	Kehtivusaeg	DAVY
12	Kehtivusaja kuupäev ja kellaaeg	2018-01-16T23:59:59.999999Z

6.10.2 Kehtivusaja kahe indikaatori kombinatsioon: pärast kuupäeva kehtiv korraldus (GADV) ja kuni kuupäevani kehtiv korraldus (GTDV)

124. näide

Investeerimisühing X esitab kauplemiskohale M 16. jaanuaril 2018 kell 10.05.32,278932 (UTC) täitmiseks korralduse, millel on pärast kuupäeva kehtivuse (GADV) ja kuni kuupäevani kehtivuse (GTDV) indikaatorid. Esitamisel peaks kehtivusaeg olema GADV ning kehtivuse kuupäev ja kellaaeg 19. jaanuar 2018, kusjuures kellaajaks märgitakse 00:00:00 (sekundi murdosad märgitakse vastavalt MiFID II artiklile 50) või kauplemiskoha kauplemise algusaeg (1. sündmus). 19. jaanuaril 2018 peaks kehtivusaeg olema GDTV ning kehtivuse kuupäev ja kellaaeg 13. jaanuar 2018, kusjuures kellaajaks märgitakse 23:59:59 (sekundi murdosad märgitakse vastavalt MiFID II artiklile 50) (2. sündmus).

1. sündmus: täitmiskorralduse esitamine

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-01-16T10:05:32.278932Z
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
10	Kehtivusaeg	GADV
12	Kehtivusaja kuupäev ja kellaaeg	2018-01-19T00:00:00.000001Z[35]
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO
J jagu – korraldusega seotud juhised		
33	Korralduse seisund	INAC[36]

[35] Või sisestage muu ajatempel enne kauplemise algust ja/või avamisoksjonit.
[36] Korralduse esitamisel kauplemiskohale on korraldus mitteaktiivne, sest kehtivusaeg on GADV.

2. sündmus: korraldus aktiveerub

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-01-19T00:00:00.000001Z[37]
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
10	Kehtivusaeg	GTDV
12	Kehtivusaja kuupäev ja kellaaeg	2018-02-13T23:59:59.999999Z
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	CHMO[38]
J jagu – korraldusega seotud juhised		
33	Korralduse seisund	ACTI

6.11 Likviidsuse pakkumine (väli 8)

Likviidsuse pakkumine kauplemiskoha liikmete või osaliste poolt toimub üldiselt järgmise kolme stsenaariumi raames:

a) liige või osaline alustab algoritmkauplemist, et rakendada turutegemise strateegiat, ning sõlmib selle tulemusena kauplemiskohaga lepingu vastavalt MiFID II artiklile 17 ja artiklile 48;

b) liige või osaline, kes pakub likviidsust (mis ei kuulu MiFID II artikli 17 kohaselt turutegemise strateegia alla), kaupleb oma arvel emitendi või kauplemiskohaga sõlmitud lepingu kohaselt;

c) likviidsust pakkuv liige või osaline täidab korraldusi klientide nimel emitendi või kauplemiskohaga sõlmitud lepingu kohaselt.

Punktides a–c loetletud likviidsuse pakkumine peab kajastuma kauplemiskoha aruandes, kus selleks täidetakse asjakohaselt väli 7 (kauplemisvolitused), väli 8 (likviidsuse pakkumine) ja väli 3 (kliendi tunnuskood), kui korraldusi täidetakse klientide nimel.

[37] Või sisestage muu ajatempel enne kauplemise algust ja/või avamisoksjonit.
[38] Korralduse aktiveerumine loetakse seisundi muutuseks turutoimingute tõttu.

125. näide

Stsenaarium	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
Punktis a) kirjeldatud tegevus	**B jagu – kauplemisvolitused ja likviidsuse pakkumine**	
	7. Kauplemisvolitused	DEAL
	8. Likviidsuse pakkumine	true
Punktis b) kirjeldatud tegevus	**B jagu – kauplemisvolitused ja likviidsuse pakkumine**	
	7. Kauplemisvolitused	DEAL
	8. Likviidsuse pakkumine	true
Punktis c) kirjeldatud tegevus	**A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed**	
	3. Kliendi tunnuskood	{LEI} või {RIIKLIK_TUNNUS}
	B jagu – kauplemisvolitused ja likviidsuse pakkumine	
	7. Kauplemisvolitused	AOTC
	8. Likviidsuse pakkumine	true

II osa. Stsenaariumid

6.12 Selgitus

Kui konkreetse stsenaariumi korral ei ole märgitud teisiti, kasutatakse kõigis II osas sätestatud stsenaariumides järgmisi üldandmeid.

Investeerimisühing X (LEI: 12345678901234567890) on kauplemiskoha M liige või osaline.

Investeerimisühing Y (LEI: ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) on samuti kauplemiskoha M liige või osaline.

Kauplemiskoha M segmendi MIC on ‘XMIC’.

Kauplemiskoha M lüüsidevaheline latentsusaeg on alla 1 millisekundi.

Finantsinstrumendi ISIN on XX0000000000.

Korralduse tunnuskood on 123456789ABC.

Kauplemiskoha M tellimusraamatu kood on XYZ9876.

Kauplemiskoha M genereeritud kauplemiskoha tehingu tunnuskood on ABC123456.

Lisaks on kohustuslikud kõik komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 andmeväljade tabelis olevad väljad. Andmeväljad tuleks tühjaks jätta üksnes siis, kui need ei ole konkreetse sündmuse korral kohaldatavad. Näiteks väli 14 (prioriteetsuspõhine kogus) ei ole kohaldatav hinna- ja ajaprioriteediga tellimusraamatute korral ning selle täitmist ei eeldata. Praktilistes näidetes käsitletakse üksnes välju, mis vajavad selgitusi. Olenemata andmete esitamise tehnilisest lahendusest (nt XML, CSV) tuleb siis, kui mõne välja võib jätta tühjaks, esitada teave nii, et pädevale asutusele oleks arusaadav, kas konkreetne väli on tühjaks jäetud.

6.13 Keskne limiidiga korralduste tellimusraamat

Käesolevad keskse limiidiga korralduste tellimusraamatu suunised hõlmavad järgmisi stsenaariume:

a) punkt 6.14.1: uued korraldused ja tühistamine/muutmine;

b) punkt 6.14.2: täiendav määratud hind;

c) punkt 6.14.3: varjatud limiidiga korralduse liigitamine;

d) punkt 6.14.4: PEG-korraldused;

e) punkt 6.14.5: stopp-korralduse liigitamine;

f) punkt 6.14.6: suunatud korraldused;

g) punkt 6.14.7: strateegiapõhiste korralduste liigitamine;

h) punkt 6.14.8: prioriteetsuse muutmine;

i) punkt 6.14.9: kauplemisetapid.

6.13.1 Uued korraldused ja tühistamine/muutmine (väli 21)

6.13.1.1 Uue korralduse saamine

Isegi kui korraldus täidetakse tellimusraamatusse kandmisel, tuleb aruandesse esimese sündmusena märkida „uus korraldus“.

126. näide

Investeerimisühing X esitab 16. jaanuaril 2018 kauplemiskohale M täitmiseks määratud hinnaga ostukorralduse (osta 1000 ühikut finantsinstrumenti hinnaga 80,00 eurot). Teave saabub kauplemiskoha M sobitamissüsteemi kell 08.05.32,278932 (UTC).

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-01-16T08:05:32.278932Z
F jagu – korralduse tunnuskood		
16	Segmendi MIC	XMIC
17	Tellimusraamatu tunnuskood	XYZ9876
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000
19	Kättesaamise kuupäev	2018-01-16
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	80.00
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI
36	Algne kogus	1000
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	1000
38	Nähtav kogus	1000
39	Kaubeldud kogus	0

6.13.1.2 Korralduse muutmine liikme või osalise poolt

127. näide

Investeerimisühing X esitab 16. jaanuaril 2018 kauplemiskohale M eespool nimetatud korralduse (osta 1000 aktsiat ISIN-koodiga XX0000000000 hinnaga 80,00 eurot) hinnamuudatuse (uus hind 81,00 eurot). Muutmistaotlus saabub kauplemiskoha M sobitamissüsteemi kell 14.47.55,179524 (UTC). Korralduse muutmist taotles investeerimisühingu X klient.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-01-16T14:47:55.179524Z
F jagu – korralduse tunnuskood		
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse	REME

	tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	81,00
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI
36	Algne kogus	1000
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	1000
38	Nähtav kogus	1000
39	Kaubeldud kogus	0

6.13.1.3 Korraldus osaliselt täidetud

128. näide

Muudetud korraldus 1000 aktsiale (ISIN XX0000000000) hinnaga 81,00 eurot (vt eelmine punkt) täidetakse osaliselt (200 aktsiat ISIN-koodiga XX0000000000 hinnaga 81,00 eurot) samal päeval, st 16. jaanuaril 2018 kell 14.48.11,544378 (UTC).

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-01-16T14:48:11.544378Z
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	PARF
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	81,00
28	Tehinguhind	81,00
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI
36	Algne kogus	1000
37	Järelejäänud kogus	800
38	Nähtav kogus	800
39	Kaubeldud kogus	200
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	ABC123456

6.13.1.4 Korraldus täielikult täidetud

129. näide

Osaliselt täidetud korraldus 800 aktsiale (ISIN XX0000000000) hinnaga 81,00 eurot (vt eelmine punkt) täidetakse seejärel täielikult (800 aktsiat ISIN-koodiga XX0000000000 hinnaga 81,00 eurot) samal päeval, st 16. jaanuaril 2018 kell 14.50.20,379545 (UTC).

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-01-16T14: 50:20.379545Z
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	81,00
28	Tehinguhind	81,00
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI
36	Algne kogus	1000
37	Järelejäänud kogus	0
38	Nähtav kogus	0
39	Kaubeldud kogus	800
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	ABC789000

6.13.1.5 Korralduse tühistamine

130. näide

Investeerimisühing X esitab 18. jaanuaril 2018 kell 14.12.34 (UTC) kauplemiskohale M taotluse tühistada korraldus müüa 2000 aktsiat ISIN-koodiga XX0000000000 hinnaga 50,00 eurot. Tühistamistaotlus saabub kauplemiskoha M sobitamissüsteemi kell 14.12.34,112856 (UTC). Korralduse tühistamist taotles investeerimisühingu X klient.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-01-18T14:12:34.112856Z
F jagu – korralduse tunnuskood		
20	Korralduse tunnuskood	987654321ABC

G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	CAME
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	50,00
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	SELL
33	Korralduse seisund [39]	
36	Algne kogus	2000
37	Järelejäänud kogus	0
38	Nähtav kogus	0
39	Kaubeldud kogus	0

6.13.2 Täiendav määratud hind (väli 25)

131. näide

Kauplemiskoht M pakub sulgemisoksjoni raames võimalust sisestada määratud hinnaga korraldus määratud hinnaga (maksimaalne ostuhind või minimaalne müügihind) ning lisada täiendav määratud hind (minimaalne ostuhind või maksimaalne müügihind). Kauplemiskohas M loetakse seda liiki korraldus aktiivseks olenemata sellest, kas väärtpaberi hind on miinimum- ja maksimumhinna vahemikus või mitte. Kauplemiskohale M esitatakse ostukorraldus maksimaalse ostuhinnaga 100 eurot ja täiendava minimaalse määratud ostuhinnaga 95 eurot.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Tehinguhinna sobitamine	Vastavalt kohtade oma liigitusele.
23	Korralduse liigitus	LMTO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	100	
25	Täiendav määratud hind	95	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
33	Korralduse seisund	ACTI	Korraldus on sulgemisoksjonil aktiivne, kuid täidetakse üksnes siis, kui sobitamishind on 95…100 eurot.

[39] See tuleks jätta tühjaks, vt punkt 6.5.

6.13.3 Varjatud limiidiga korralduse liigitamine

132. näide

Investeerimisühing X esitab 7. märtsil 2018 kell 10.10.32,652758 (UTC) kauplemiskohale M täitmiseks varjatud limiidiga ostukorralduse. Korraldus on osta kokku 150 aktsiat hinnaga 100,00 eurot. Varjatud korraldus on esitatud nii, et kogus 50 aktsiat on tellimusraamatus avalik ja 100 aktsiat on turuosaliste eest varjatud (1. sündmus).

14 sekundit pärast kauplemiskoha M tellimusraamatusse sisestamist täidetakse varjatud korralduse kogu nähtav kogus (50 aktsiat) (2. sündmus).

Pärast varjatud korralduse osalist sooritamist uuendatakse nähtav kogus viivitamata. Sel juhul lisatakse kauplemiskohas M 3 mikrosekundit tulenevalt kauplemiskoha süsteemide väikesest latentsusest (3. sündmus).

1. sündmus: korraldus saabub tellimusraamatusse

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	2	Vastavalt kauplemiskoha M oma liigitusele
23	Korralduse liigitus	LMTO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	100,00	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	150	

37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	150	
38	Nähtav kogus	50	

2. sündmus: täidetakse varjatud korralduse kogu nähtav kogus

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:10:46.652785Z	Tehing toimub 14 sekundit pärast tellimusraamatusse sisestamist
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:10:32.652785Z	*Muutumatu*
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	PARF	Korraldus täidetakse osaliselt
I jagu – hinnad			
28	Tehinguhind	100,00	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	150	*Muutumatu*
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	100	
38	Nähtav kogus	0	Nähtava koguse uuendamine tuleks kajastada järgmise sündmuse all
39	Kaubeldud kogus	50	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	ABC123456	

3. sündmus: varjatud korralduse nähtav kogus uuendatakse

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:10:46.652788Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:10:46.652788Z	Uuendamisel saab varjatud korraldus uue prioriteetsuse ajatempli (uuendamissündmuse kuupäev ja kellaaeg)
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	REMA	Turutoimingute poolt asendatud (automaatne).
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	150	*Muutumatu*
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	100	*Muutumatu*
38	Nähtav kogus	50	

6.13.4 PEG-korraldused[40]

133. näide

7. märtsil 2018 kell 10.10.32,652785 (UTC) esitab investeerimisühing kauplemiskohale M täitmiseks PEG-ostukorralduse. Korralduse esitamisel määrab kaupleja järgmise:

- kogus on 150 ja varjatud kogus puudub;
- korraldus seotakse kauplemiskohas parima pakkumisega;
- korraldus seotakse pakkumishinnaga kuni 100,10 eurot (st kui pakkumishind on üle 100,10 euro, jääb korraldus seotuks hinnaga 100,10 eurot).

[40] Selles näites on PEG-korralduseks määratud hinnaga ostu- või müügikorraldus ettenähtud arvule väärtpaberitele nähtava hinnaga, mis on seatud järgima kauplemiskoha tellimusraamatu hinnapunkti.

Kauplemiskoht M menetleb PEG-korraldust nii:

korraldusele määratakse madalaim prioriteetsus;

korraldus seotakse parima pakkumishinnaga latentsusega 50 ms.[41]

Tellimusraamatu seis[42] enne korralduse esitamist kauplemiskohale M

BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100
100	99,75	100,20	100

1. sündmus: korraldus saabub kauplemiskoha M tellimusraamatusse

Kauplemiskoha M tellimusraamatu seis korralduse sisestamisel

BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
250	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100
100	99,75	100,20	100

Kauplemiskoha M tellimusraamatus lisatakse esitatud PEG-korraldus automaatselt teiste parima pakkumishinnaga korralduste juurde (algne määratud hind 99,99 eurot).

[41] See latentsus tuleneb konkreetse PEG-korralduste võimalust pakkuva kauplemiskoha tehnilistest põhjustest (tavaliselt seda teavet ei avalikustata).

[42] Iga alljärgneva tabeli kahes vasakpoolses veerus („BID“) on aktsiate ostukorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud, ja kahes parempoolses veerus („ASK“) on aktsiate müügikorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:10:32.652785Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:10:32.652785Z	PEG-korraldusele määratakse madalaim prioriteetsus. Prioriteetsuse ajatemplid tuleks siiski märkida, et määrata eri PEG-korralduste järjekord.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	P	Vastavalt kauplemiskoha M oma liigitusele
23	Korralduse liigitus	LMTO	PEG-korraldus on määratud hinnaga korraldus, mille määratud hind muutub automaatselt
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	99,99	
27	Seotud määratud hind	100,10	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	150	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	150	
38	Nähtav kogus	150	Varjatud kogus puudub

2. sündmus: PEG-korralduse määratud hind muutub pärast uue korralduse sisestamist tellimusraamatusse

Kell 10.10.45,685975 (UTC) sisestatakse tellimusraamatusse päeva jooksul kehtiv ostukorraldus 200 aktsiale hinnaga 100,00 eurot. Selle korralduse alusel tehinguid ei tehta ja see jääb tellimusraamatus nähtavaks. Seetõttu kohandatakse 50 millisekundit hiljem PEG-korralduse määratud hinda vastavalt viimase sisestatud müügikorralduse määratud hinnale.

Kauplemiskoha M tellimusraamatu seis

BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
350	100,00	100,03	100
100	99,99	100,05	100
100	99,98	100,08	100
100	99,95	100,10	100
100	99,90	100,15	100
100	99,80	100,20	100
100	99,75		

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:10:45.735975Z	Korraldus kohandub sisestatud uue korraldusega 50 millisekundi viivitusega
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:10:32.735975Z	Muutumatu.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	REMA	Turutoimingute poolt asendatud. Kauplemiskoha süsteem kohandab PEG-korralduse määratud hinda automaatselt
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	100,00	Määratud hind kohandub uue parima pakkumise järgi
27	Seotud määratud hind	100,10	Muutumatu

3. sündmus: tellimusraamatusse sisestatakse uus määratud hinnaga ostukorraldus, mille alusel kaubeldakse hinnaga kuni 100,15 eurot ja mida täielikult ei täideta

Kell 10.10.59,256789 (UTC) sisestatakse päeva jooksul kehtiv määratud hinnaga ostukorraldus 600 aktsiale hinnaga 100,15 eurot. Selle korralduse alusel kaubeldakse 100 aktsiat vastavalt hindadega 100,03 eurot, 100,05 eurot, 100,08 eurot, 100,10 eurot ja 100,15 eurot. Järelejäänud kogus (100) jääb tellimusraamatusse. 50 millisekundit pärast viimast sooritust kohandatakse turutoimingutest tulenevalt PEG-korralduse määratud hinda tasemelt 100,00 eurot tasemele 100,10 eurot: PEG-korralduse

määratud hinda ei saa seada sellest kõrgemale, sest kaupleja on määratud hinna ülempiiriks 100,10 eurot.

Kauplemiskoha M tellimusraamatu seis

BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	100,15	100,20	100
150	100,10		
200	100,00		

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:10:59.306789Z	50 ms pärast viimast sooritust
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:10:32.652785Z	*Muutumatu*
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	REMA	Turutoimingute poolt asendatud. Kauplemiskoha M süsteem kohandab PEG-korralduse määratud hinda automaatselt
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	100,10	Määratud hinna ülempiir on 100,10 (nagu on märgitud väljal 27)
27	Seotud määratud hind	100,10	*Muutumatu*

6.13.5 Stopp-korralduse liigitamine

134. näide

Investeerimisühing esitab 7. märtsil 2018 kell 10.05.32,652785 (UTC) stopp-korralduse 150 aktsia ostuks kauplemiskohas M. Korraldus on määratud käivituma, kui aktsia kauplemishind on 100,02 eurot või rohkem. Käivitumisel muutub korraldus:

- variandi A korral turukorralduseks (määratud hinnata) ning

- variandi B korral määratud hinnaga korralduseks (määratud hind 101,00 eurot).

Korralduse kehtivusaeg on „kuni tühistamiseni“, st korraldus jääb tellimusraamatusse kuni käivitumise või tühistamiseni.

1. sündmus: korraldus saabub kauplemiskoha M tellimusraamatusse

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:05:32.652785Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:05:32.652785Z	Et korraldus on äsja tellimusraamatusse saabunud, on selle prioriteetsuse ajatempliks sisestamise kuupäev ja kellaaeg. Stopp-korralduse prioriteetsuse ajatemplit arvestatakse võrdluses teiste stopp-korraldustega.
F jagu – korralduse tunnuskood			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Variant A: 4 ja variant B: S	Vastavalt kauplemiskoha oma liigitusele
23	Korralduse liigitus	STOP	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	Variant A: [tühi] ja variant B: 101,00	
26	Stopp-hind	100,02	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
33	Korralduse seisund	INAC	
36	Algne kogus	150	

2. sündmus: turuosaline ostab kauplemiskohas M 20 aktsiat hinnaga 100,02 eurot, käivitades sellega stopp-korralduse

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:05:55.652785Z	Käivitav sündmus toimub 23 sekundit pärast stopp-korralduse saabumist kauplemiskohta.
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud			
10	Kehtivusaeg	IOCV	„Täida või tühista kohe“
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	TRIG	Käivitatud
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Variant A: 4 Variant B: S	Aktiveerimisel jääb korralduse liik samaks, kuid muutub liigitus (väli 23)
23	Korralduse liigitus	LMTO	Aktiveerimisel tuleks stopp-korraldus liigitada määratud hinnaga korralduseks.
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	Variant A: [tühi] ja variant B: 101,00	
26	Stopp-hind	100,02	Stopp-hind on endiselt märgitud, kuid seda ei tuleks arvestada, kui korralduse seisundiks (väli 33) saab „ACTI“
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ACTI	Stopp-korralduse käivitumisel saab selle seisundiks „aktiivne“.

6.13.6 suunatud korraldused;

135. näide

Investeerimisühing X esitab 7. märtsil 2018 kell 10.05.32 (UTC) kauplemiskohale M täitmiseks määratud hinnaga ostukorralduse. Korraldus on osta 150 aktsiat hinnaga 100,02 eurot. Korralduse esitamisel kauplemiskohale M määrab kaupleja, et korraldus tuleb suunata teise kauplemiskohta

(kauplemiskoht N), kui seda ei õnnestu kauplemiskohas M täita täielikult (variant A) või osaliselt (variant B). Mõlema variandi korral suunatakse kauplemata kogus (variant A) või allesjäänud kogus (variant B) kauplemiskohta N.

Suunatud korraldus täidetakse kauplemiskohas N osaliselt. See kauplemiskoha N tehing tuleks registreerida kauplemiskoha M süsteemides.

Mõlema variandi korral määrab kaupleja ka, et kui korraldust ei õnnestu kauplemiskohas N täielikult täita, tuleks korraldus tuua tagasi kauplemiskohta M. Seega taasaktiveeritakse korraldus kauplemiskoha M tellimusraamatus pärast osalist täitmist kauplemiskohas N.

Korralduse suunamiseks kauplemiskohast M kauplemiskohta N pakub kauplemiskoha N liikmeks olev investeerimisühing Z otsese elektroonilise juurdepääsu teenust.

Tellimusraamatute seis[43] enne korralduse esitamist kauplemiskohale M

Tellimusraamatu seis kauplemiskohas M, kuhu korraldus algul esitatakse

BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	99,99	100,03	100
100	99,98	100,05	100
100	99,95	100,08	100
100	99,90	100,10	100
100	99,80	100,15	100

Tellimusraamatu seis kauplemiskohas N, kuhu korraldus suunatakse

BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	99,99	100,01	100
100	99,98	100,03	100
100	99,95	100,04	100
100	99,90	100,05	100
100	99,80	100,08	100

1. sündmus: korraldus saabub kauplemiskoha M tellimusraamatusse

Kauplemiskoha M tellimusraamatu seis korralduse sisestamisel

BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
150	100,02	100,03	100
100	99,99	100,05	100
100	99,98	100,08	100
100	99,95	100,10	100
100	99,90	100,15	100
100	99,80		

[43] Iga alljärgneva tabeli kahes vasakpoolses veerus („BID“) on aktsiate ostukorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud, ja kahes parempoolses veerus („ASK“) on aktsiate müügikorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud. Käesolevas suunises vastab igale määratud hinnaga korraldusele üks korraldus.

Tulenevalt kauplemiskoha M tellimusraamatu seisust ei ole esitatud määratud hinnaga korraldust võimalik täita (see ei sobitu vastaspoolega).

Korraldus tuleks kajastada kauplemiskoha M registris uue korraldusena (vt punkt 6.13.1). Lisaks tuleks esitada suunamisstrateegia (väli 47) tähtnumbriline kirjeldus (kuni 50 tähemärki) vastavalt kauplemiskoha M tehnilisele kirjeldusele.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
J jagu – korraldusega seotud juhised			
47	Suunamisstrateegia	ROUTING_TO_TVN_ONLY	Tähtnumbriline kirjeldus (kuni 50 tähemärki) vastavalt kauplemiskoha M tehnilisele kirjeldusele

2. sündmus: korraldus suunatakse kauplemiskohta N

Variant A

Et tehingut ei ole võimalik kauplemiskoha M tellimusraamatusse sisestamisel hinnaga 100,02 eurot täita, suunatakse tellimus vastavalt kaupleja antud juhisele kauplemiskohta N. Selle tulemusena kustutatakse korraldus kauplemiskoha M tellimusraamatust. Et aga korraldust ei ole võimalik kauplemiskohas N täielikult täita, tuleb kauplemata kogus vastavalt kaupleja algsetele juhistele tagasi kauplemiskoha M tellimusraamatusse.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:05:32.652788Z	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	CHMO	„Seisundi muutmine turutoimingute poolt“
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ROUT	Korraldus suunatakse kauplemiskohta N.
36	Algne kogus	150	*Muutumatu*

37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	150	See väli kajastab ka teise kauplemiskohta ümbersuunatud kogust
38	Nähtav kogus	0	Kui korraldus suunatakse teise kauplemiskohta, ei näidata kauplemiskohas M korralduse kogust.

Variant B

Korraldus täideti osaliselt kauplemiskohas M (osteti 25 aktsiat) ja ülejäänud kogus (125 aktsiat) suunati seejärel kauplemiskohta N. Korralduse suunamine pärast osalist sündmust kajastatakse kauplemiskoha M registris järgmistel väljadel.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ROUT	Korraldus suunatakse kauplemis-kohta N.
36	Algne kogus	150	*Muutumatu*
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	125	Näitab kogust, mis on pärast kauplemiskohas M 25 aktsia ostmist veel kauplemata
38	Nähtav kogus	0	Kui korraldus suunatakse teise kauplemiskohta, ei näidata kauplemiskohas M korralduse kogust.
39	Kaubeldud kogus		25 aktsia ostu kajastati eelmise sündmuse all

Järgmine tabel näitab, kuidas kajastatakse kauplemiskohast M suunatud korralduse saabumist kauplemiskoha N registris.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	Kauplemiskoha N liikme investeerimisühingu Z LEI, kes edastab korralduse kauplemiskoha M nimel	
2	Otsene elektrooniline juurdepääs	true	

3	Kliendi tunnuskood	Kauplemiskoha M {LEI}	Sel juhul on kauplemiskoht M kauplemiskoha N liikme (investeerimisühingu Z) klient. Kui nende vahel on veel vahendajaid, ei peaks kauplemiskoha M LEId sellele väljale märkima.
B jagu – kauplemisvolitused ja likviidsuse pakkumine			
7	Kauplemisvolitused	AOTC	Investeerimisühing Z tegutseb kauplemiskoha M nimel.
F jagu – korralduse tunnuskood			
16	Segmendi MIC	Kauplemiskoha N segmendi MIC-kood	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	IOC_ORDER	Vastavalt kauplemiskoha N oma liigitusele
23	Korralduse liigitus	LMTO	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	Variant A: 150 ja variant B: 125	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	Variant A: 150 ja variant B: 125	

3. sündmus: korralduse saabumisel kauplemiskoha M tellimusraamatusse täidetakse korraldus osaliselt

Korraldus tuleks kajastada kauplemiskoha N registris osaliselt täidetud korraldusena (vt punkt 6.13.1.4). Lisaks tuleks väljale 48 märkida järgmine teave:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
J jagu – korraldusega seotud juhised			
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	DEF54321	

Variant A

Kauplemiskoha N tellimusraamatusse sisestamisel ostetakse kauplemiskohas N 100 aktsiat. See kauplemiskohas N toimunud ost tuleb kajastada kauplemiskoha M registris algse korralduse andmetes.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:05:32.662788Z	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	PARF	Korraldus täidetakse osaliselt
I jagu – hinnad			
28	Tehinguhind	100,01	Korraldus täidetakse kauplemis-kohas N osaliselt hinnaga 100,01
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ROUT	*Muutumatu*
36	Algne kogus	150	*Muutumatu*
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	50	
38	Nähtav kogus	0	Sest korralduse seisundiks on endiselt „suunatud“.
39	Kaubeldud kogus	100	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood		See väli tuleks jätta tühjaks, sest tehingut ei sooritatud kauplemis-kohas M

Variant B

Enne kauplemiskohta N suunamist täidetakse korraldus osaliselt kauplemiskohas M (ostetakse 25 aktsiat). Seega hõlmab kauplemiskohta N suunatud korraldus üksnes 125 aktsiat. Korralduse saabumisel kauplemiskoha N tellimusraamatusse täidetakse korraldus osaliselt (ostetakse 100 aktsiat).

Kauplemiskohas N sooritatud tehingud tuleks kajastada kauplemiskoha M registris vastavalt eelmises tabelis näidatule, v.a järgmised väljad.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	PARF	Korraldus täidetakse osaliselt
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ROUT	
36	Algne kogus	150	Variandi B korral on algne kogus muutumatu
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	25	25 aktsiat osteti kauplemis-kohas M juba enne suunamist.
38	Nähtav kogus	0	
39	Kaubeldud kogus	100	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood		See väli tuleks jätta tühjaks, sest tehingut ei sooritatud kauplemis-kohas M

4. sündmus: suunatud korraldus taasaktiveeritakse kauplemiskoha M tellimusraamatus

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:05:32.662791Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:05:32.662791Z	Kauplemiskohta N suunamisel kaotas korraldus prioriteetsuse ajatempli. Uus prioriteetsuse ajatempel on kauplemiskoha M tellimus-raamatusse tagasisaabumise aeg.
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine,	CHMO	„Seisundi muutmine turu-toimingute poolt“

	korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine		
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	100,02	*Muutumatu*
J jagu – korraldusega seotud juhised			
33	Korralduse seisund	ACTI	Selle sündmuse raames muutub korraldus kauplemiskoha M tellimusraamatus aktiivseks.
36	Algne kogus	150	*Muutumatu*
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	Variant A: 50 ja variant B: 25	
38	Nähtav kogus	Variant A: 50 ja variant B: 25	

6.13.7 Strateegiapõhiste korralduste liigitamine (väli 46)

6.13.7.1 Tuletamisfunktsionaalsus

136. näide

Investeerimisühingu X korraldus

Investeerimisühing X soovib kauplemiskohas M osta juuli optsioone (täitmishind 225). 10. märtsil 2018 kell 10.07.16,523871 (UTC) sisestab investeerimisühing X juuliks otsese korralduse, et osta 200 ostuoptsiooni hinnatasemel 225 hinnaga 13 eurot. Juuli ostuoptsioonide kood on kauplemiskoha M tellimusraamatus 256718 ja ISIN XX1234567890.

Investeerimisühingu Y korraldus

Teine investeerimisühing (ühing Y) soovib kauplemiskohas M osta augusti optsioone (täitmishind 225). 7. märtsil 2018 kell 10.09.38,981242 (UTC) sisestab investeerimisühing Y augustiks otsese korralduse, et müüa 100 ostuoptsiooni hinnatasemel 225 hinnaga 15,5 eurot. Augusti ostuoptsioonide kood on kauplemiskoha M tellimusraamatus 256735 ja ISIN XXABCDEFGHIJ.

Tuletatud korraldus – optsioonide kalendrivahe

Vastavalt kauplemiskoha M tuletamisfunktsionaalsusele tekib kahest otsesest korraldusest optsioonide kalendrivahe strateegial põhinev tuletatud korraldus. Tuletatud korraldus on müüa 100 juuli-augusti FCALi hinnaga 2,5 eurot. See avalikustatakse turul infosüsteemi kaudu. Kauplemiskoha M tellimusraamatus on juuli-augusti FCAL 225 kood 256786.

Investeerimisühingu Z korraldus

Investeerimisühing Z (LEI KLMNOPQRST1234567890) soovib sisestada korralduse samasse optsioonide kalendrivahesse. Investeerimisühing Z sisestab 7. märtsil 2018 kell 10.09.56,684251 (UTC) kalendrivahe korralduse osta 100 juuli-augusti FCAL 225 hinnaga 2,5 eurot. Kauplemiskoha M

tellimusraamatus on juuli-augusti FCAL 225 kood 256786. See täidetakse viivitamata eespool nimetatud tuletatud korralduse suhtes.

1. sündmus: investeerimisühingu X korraldus saabub tellimusraamatusse

Tellimusraamatu seis[44] korralduse sisestamisel (uus on korraldus punase taustaga)

Juuli 225 ost			
BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Augusti 225 ost			
BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	15,25	16,50	100
100	15,20	16,55	100
100	15,15	16,65	100

Juuli-augusti FCAL 225			
BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	2,00	5,25	100

Juuli 225 ost: investeerimisühingu X otsene korraldus on osta 200 juuli ostuoptsiooni hinnatasemel 225 hinnaga 13 eurot. Kauplemiskoha M tellimusraamatu juuli 225 ostuoptsioonide kood on 256718. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	12345678901234567890	
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:07:16.523871Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			

[44] Iga alljärgneva tabeli kahes vasakpoolses veerus („BID“) on aktsiate ostukorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud, ja kahes parempoolses veerus („ASK“) on aktsiate müügikorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud. Käesolevas suunises on igal hinnatasemel ainult üks korraldus.

13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:07:16.523871Z	Et korraldus on äsja tellimusraamatusse saabunud, on selle prioriteetsuse ajatempliks sisestamise kuupäev ja kellaaeg.
15	Järjenumber	3758945	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256718	
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX1234567890	
20	Korralduse tunnuskood	Xj26F458s	Kauplemiskoha kordumatu korralduse kood.
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	Isegi kui korraldus täidetakse tellimusraamatusse kandmisel, tuleb aruandesse esimese sündmusena märkida „uus korraldus“.
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga	Vastavalt kauplemiskoha oma liigitusele.
23	Korralduse liigitus	LMTO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	13	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	200	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	200	
38	Nähtav kogus	200	
46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood		Tühi, sest on veel sooritamata.

2. sündmus: investeerimisühingu Y korraldus saabub tellimusraamatusse

Tellimusraamatu seis[45] korralduse sisestamisel (uus korraldus on punase taustaga)

[45] Iga alljärgneva tabeli kahes vasakpoolses veerus („BID“) on aktsiate ostukorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud, ja kahes parempoolses veerus („ASK“) on aktsiate müügikorraldused, mis on juba tellimusraamatutesse sisestatud. Käesolevas suunises on igal hinnatasemel ainult üks korraldus.

Juuli 225 ost			
BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Augusti 225 ost			
BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	100

Juuli-augusti FCAL 225			
BID		ASK	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	2,00	5,25	100

Augusti 225 ost: investeerimisühingu X otsene korraldus on müüa 100 augusti ostuoptsiooni hinnatasemel 225 hinnaga 15,5 eurot. Kauplemiskoha M tellimusraamatu augusti 225 ostuoptsioonide kood on 256735. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST	
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Et korraldus on äsja tellimusraamatusse saabunud, on selle prioriteetsuse ajatempliks sisestamise kuupäev ja kellaaeg.
15	Järjenumber	3758946	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256735	Kauplemiskoha tellimusraamatu kood.
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XXABCDEFGHIJ	

20	Korralduse tunnuskood	Xj26F459n	Kauplemiskoha M kordumatu korralduse kood.
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	Isegi kui korraldus täidetakse tellimusraamatusse kandmisel, tuleb aruandesse esimese sündmusena märkida „uus korraldus“.
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga	Vastavalt kauplemiskoha M oma liigitusele
23	Korralduse liigitus	LMTO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	**15,5**	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	100	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	100	
38	Nähtav kogus	100	
46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood		Tühi, sest on veel sooritamata.

3. sündmus: tuletatud korraldus sisestatakse tellimusraamatusse

Tellimusraamatu seis[46] tuletatud korralduse sisestamisel (uus korraldus on punase taustaga)

Juuli 225 ost			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Augusti 225 ost			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	100

[46] Käesolevas suunises on igal hinnatasemel ainult üks korraldus.

Juuli-augusti FCAL 225			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	2,00	2,50	100
		5,25	100

Juuli-augusti FCAL 225 tellimusraamatus: kauplemiskoht M genereerib investeerimisühingute X ja Y sisestatud mõlema otsese korralduse põhjal tuletatud korralduse seoses juuli ja augusti ostuoptsioonidega. Tuletatud korraldus on müüa 100 juuli-augusti FCALi hinnaga 2,5 eurot. Kauplemiskoha M tellimusraamatus on juuli-augusti FCAL 225 kood 256786. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad. Väljad 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7 ja 8 on alati tühjad, sest see on tuletatud korraldus, mille on genereerinud kauplemiskoht, mitte liige/osaline.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:09:38.981242Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:09:38.981242Z	Et korraldus on äsja tellimusraamatusse saabunud, on selle prioriteetsuse ajatempliks sisestamise kuupäev ja kellaaeg.
15	Järjenumber	3758947	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256786	Kauplemiskoha M tellimusraamatu kood.
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Et strateegiad ei ole finantsinstrumendid, ei ole neil ISIN-koodi ja seepärast lisatakse strateegia elementide ISIN-koodid.
20	Korralduse tunnuskood	Xj26F460g	Kauplemiskoha M kordumatu korralduse kood.
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	Isegi kui korraldus täidetakse tellimusraamatusse kandmisel, tuleb aruandesse esimese sündmusena märkida „uus korraldus“.
H jagu – korralduse liik			

22	Korralduse liik	Tuletatud	Vastavalt kauplemiskoha oma liigitusele.
23	Korralduse liigitus	LMTO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	**2,5**	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	
33	Korralduse seisund	IMPL	Näitab, et see korraldus on tuletatud otsestest korraldustest.
36	Algne kogus	100	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	100	
38	Nähtav kogus	100	
46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood		Tühi, sest on veel sooritamata.

4. sündmus: investeerimisühingu Z korraldus saabub tellimusraamatusse

Tellimusraamatu seis (uus korraldus on punase taustaga)

Juuli 225 ost			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
200	13,00	13,25	100
100	11,25	13,30	100
100	11,20	13,35	100
100	11,15		

Augusti 225 ost			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	15,25	15,50	100
100	15,20	16,50	100
100	15,15	16,55	100
		16,65	

Juuli-augusti FCAL 225			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	2,50	2,50	100
100	2,00	5,25	100

Juuli-augusti FCAL 225: investeerimisühingu Z kalendrivahe korraldus on osta 100 juuli-augusti FCAL 225 hinnaga 2,5 eurot. Kauplemiskoha M tellimusraamatus on juuli-augusti FCAL 225 kood 256786. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	KLMNOPQRST1234567890	
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Et korraldus on äsja tellimusraamatusse saabunud, on selle prioriteetsuse ajatempliks sisestamise kuupäev ja kellaaeg.
15	Järjenumber	3759523	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256786	Kauplemiskoha M tellimusraamatu kood.
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Et strateegiad ei ole finantsinstrumendid, ei ole neil ISIN-koodi ja seepärast lisatakse strateegia elementide ISIN-koodid.
20	Korralduse tunnuskood	Xj26H127c	Kauplemiskoha M kordumatu korralduse kood.
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	Isegi kui korraldus täidetakse tellimusraamatusse kandmisel, tuleb aruandesse esimese sündmusena märkida „uus korraldus“.
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga	Vastavalt kauplemiskoha oma liigitusele
23	Korralduse liigitus	LMTO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	2,5	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
33	Korralduse seisund	ACTI	
36	Algne kogus	100	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	100	
38	Nähtav kogus	100	

46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood		Tühi, sest on veel sooritamata.

5. sündmus: täitmine kalendrivahe tellimusraamatus ja muudatused otsestes korraldustes.

Tellimusraamatu seis[47] täitmise ajal

Juuli 225 ost			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	13,00	13,00	100
100	11,25	13,25	100
100	11,20	13,30	100
100	11,15	13,35	100

Augusti 225 ost			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	15,50	15,50	100
100	15,25	16,50	100
100	15,20	16,55	100
100	15,15	16,65	100

Juuli-augusti FCAL 225			
BID		**ASK**	
Kogus	Määratud hind	Määratud hind	Kogus
100	2,50	2,50	100
100	2,00	5,25	100

Investeerimisühingu Z kalendrivahe korraldus osta 100 juuli-augusti FCAL 225 hinnaga 2,5 eurot täidetakse täielikult. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	KLMNOPQRST1234567890	Muutumatu
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Selle sündmuse aeg.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			

[47] Oranži taustaga korraldused täidetakse, mis omakorda ajakohastab sinise taustaga korralduse ja täidab täielikult lilla taustaga korralduse.

13	Prioriteetsuse ajatempel		Tühi, sest korraldus on täielikult täidetud ega ole enam aktiivne.
15	Järjenumber	3759539	Selle sõnumi järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256786	Muutumatu
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Muutumatu
20	Korralduse tunnuskood	Xj26H127c	Muutumatu
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL	Korraldus täideti täielikult.
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga	Muutumatu
23	Korralduse liigitus	LMTO	Muutumatu
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	2,5	Muutumatu
28	Tehinguhind	2,5	Täitmishind.
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	Muutumatu
33	Korralduse seisund		Tühi, sest korraldus on täidetud täielikult.
36	Algne kogus	100	Muutumatu
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	0	Järelejäänud kogus on nüüd 0.
38	Nähtav kogus	0	Nähtav kogus on 0, sest see on täielikult täidetud.
39	Kaubeldud kogus	100	Vastavalt kaubeldud kogusele.
46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood		Tühi, sest korraldus sisestati otse kalendrivahe tellimusraamatusse.
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	TEKXC456GH20	Täidetakse toimunud tehingu kordumatu tehingu tunnuskoodiga.

Kalendrivahe tellimusraamatu müügikorraldus: tuletatud korraldus müüa 100 juuli-augusti FCALi hinnaga 2,5 eurot täideti täielikult. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad: Väljad 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7 ja 8 on alati tühjad, sest see on tuletatud korraldus, mille on genereerinud kauplemiskoht, mitte liige/osaline.

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:09:56.684251Z	Selle sündmuse aeg.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel		Tühi, sest korraldus on täielikult täidetud ega ole enam aktiivne.
15	Järjenumber	3759540	Selle sõnumi järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256786	Muutumatu
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX1234567890, XXABCDEFGHIJ	Muutumatu
20	Korralduse tunnuskood	Xj26F460g	Muutumatu
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL	Korraldus täideti täielikult.
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Tuletatud	Muutumatu
23	Korralduse liigitus	LMTO	Muutumatu
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	2,5	Muutumatu
28	Tehinguhind	2,5	Täitmishind.
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	Muutumatu
33	Korralduse seisund		Tühi, sest korraldus on täidetud täielikult.
36	Algne kogus	100	Muutumatu
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	0	Järelejäänud kogus on nüüd 0.
38	Nähtav kogus	0	Nähtav kogus on 0, sest see on täielikult täidetud.
39	Kaubeldud kogus	100	Vastavalt kaubeldud kogusele.
46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood	Xj26K983c	Täidetakse viidetega tehingu aluseks olnud otsestele korraldustele.
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	TEKXC456GH20	Täidetakse toimunud tehingu kordumatu tehingu tunnus-koodiga.

Juuli 225 ost: investeerimisühingu X otsene korraldus osta 200 juuli ostuoptsiooni hinnatasemel 225 hinnaga 13 eurot täidetakse osaliselt, 100 optsiooni ulatuses. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	12345678901234567890	Muutumatu
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-03-07T10:07:16.523871Z	Otsese korralduse sisestamise aeg
15	Järjenumber	3759541	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256718	Muutumatu
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX1234567890	Muutumatu
20	Korralduse tunnuskood	Xj26F458s	Muutumatu
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	PARF	
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga	Muutumatu
23	Korralduse liigitus	LMTO	Muutumatu
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	13	Muutumatu
28	Tehinguhind	13	Täitmishind.
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	Muutumatu
33	Korralduse seisund	ACTI	Muutumatu
36	Algne kogus	200	Muutumatu
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	100	.
38	Nähtav kogus	100	
39	Kaubeldud kogus	100	Vastavalt sündmusega seoses kaubeldud kogusele.

46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood	Xj26K983c	Täidetakse viidetega tehingu aluseks olnud tuletatud korralduse aluseks olnud otsestele korraldustele.
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	TEKXC456GH18	Täidetakse toimunud tehingu kordumatu tehingu tunnuskoodiga. See tehingu tunnuskood on muu kui kalendrivahe tellimusraamatu tunnuskood.

Augusti 225 ost: investeerimisühingu Y otsene korraldus müüa 100 augusti ostuoptsiooni hinnatasemel 225 hinnaga 15,5 eurot on täidetud täielikult. Alljärgnevas tabelis on esitatud põhiväljad, ent mitte kõik täidetavad väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed			
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST	Muutumatu
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-03-07T10:09:56.684251Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel		Tühi, sest korraldus on täielikult täidetud ega ole enam aktiivne.
15	Järjenumber	3759542	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
17	Tellimusraamatu tunnuskood	256735	Muutumatu
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XXABCDEFGHIJ	Muutumatu
20	Korralduse tunnuskood	Xj26F459n	Muutumatu
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL	Korraldus täideti täielikult.
H jagu – korralduse liik			
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga	Muutumatu
23	Korralduse liigitus	LMTO	Muutumatu
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	15,5	Muutumatu
28	Tehinguhind	15,5	Täitmishind.

J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	Muutumatu
33	Korralduse seisund		Tühi, sest korraldus on täidetud täielikult.
36	Algne kogus	100	Muutumatu
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	0	Järelejäänud kogus on nüüd 0.
38	Nähtav kogus	0	Nähtav kogus on 0, sest see on täielikult täidetud.
39	Kaubeldud kogus	100	Vastavalt kaubeldud kogusele.
46	Strateegiapõhise korralduse tunnuskood	Xj26K983c	Täidetakse viidetega tehingu aluseks olnud tuletatud korralduse aluseks olnud otsestele korraldustele.
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	TEKXC456GH19	Täidetakse toimunud tehingu kordumatu tehingu tunnuskoodiga. See tehingu tunnuskood on muu kui kalendrivahe tellimusraamatu tunnuskood.

6.13.7.2 Eraldamisfunktsionaalsus

Sama metoodikat tuleks kasutada ka eraldatud tehingute korral.

6.13.8 Prioriteetsuse muutmine

Kirjeldatakse järgmisi olukordi:

- prioriteetsuse ajatemplid hinna nähtavuse ja ajaprioriteediga kauplemissüsteemis;
- prioriteetsuse ajatemplid ja prioriteetsuspõhine kogus koguse ning aja prioriteediga kauplemissüsteemis;
- prioriteetsuse ajatemplid ja prioriteetsuspõhine korralduse kogus proportsionaalse sobitamisega kauplemissüsteemis.

6.13.8.1 Hinna nähtavuse ajaprioriteetsus

137. näide

Investeerimisühing X sisestab 30. juunil 2018 kell 11.20.30,112121 (UTC) uue tühistamiseni kehtiva ostukorralduse 50 aktsiale määratud hinnaga 10 000 eurot (1. sündmus). Minut hiljem, kell 11.20.31,354454 (UTC), sisestab investeerimisühing Y uue päeva jooksul kehtiva ostukorralduse 70 aktsiale sama määratud hinnaga 10 000 eurot (2. sündmus).

Hinna- ja ajaprioriteetsuse eeskirja tõttu asetub 70 aktsia korraldus kauplemiskoha tehinguraamatus 50 aktsia korraldusega samale hinnatasemele, ent sellest tahapoole. Prioriteetsuse erinevus tuleneb prioriteetsuse ajatempli väljal olevatest väärtustest.

Kui 50 aktsia korraldust muudetakse 27. juunil 2018 kell 11.20.33,344541 (UTC), suurendades kogust 55 aktsiale, kaotab see prioriteetsuse 70 aktsia korralduse suhtes. Seega tuleks korralduste selliste muudatuste täpne aeg märkida prioriteetsuse ajatempli väljale (3. sündmus).

Selles kauplemiskohas on tühistamiseni kehtivate korralduste tähtaeg 1 aasta.

1. sündmus: uue tühistamiseni kehtiva ostukorralduse sisestamine 50 aktsia jaoks

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T11:20:30.112121Z
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
10	Kehtivusaeg	GTCA
12	Kehtivusaja kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T23:59:59.999999Z
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber		
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T11:20:30.112121Z
F jagu – korralduse tunnusandmed		
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	10,000
28	Tehinguhind	
J jagu – korraldusega seotud juhised		
36	Algne kogus	50

2. sündmus: uue päeva jooksul kehtiva ostukorralduse sisestamine 70 aktsia jaoks

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T11:20:31.354454Z
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		

10	Kehtivusaeg	DAVY
12	Kehtivusaja kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T23:59:59.999999Z
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber		
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T11:20:31.354454Z
F jagu – korralduse tunnusandmed		
20	Korralduse tunnuskood	45533344ABC
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	10,000
36	Algne kogus	70

3. sündmus: 50 aktsia korraldust muudetakse

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T11:20:33.344541Z
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
10	Kehtivusaeg	GTCV
12	Kehtivusaja kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T23:59:59.999999Z
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber		
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T11:20:33.344541Z
F jagu – korralduse tunnuskood		
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	REME
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	10,000
J jagu – korraldusega seotud juhised		
36	Algne kogus	55

6.13.8.2 Mahu- ja ajaprioriteet

138. näide

Investeerimisühing X sisestab 27. juunil 2018 kell 11.20.30,112121 (UTC) uue ostukorralduse 100 aktsiale teatud hinnaga (1. sündmus).

Minut hiljem, kell 11.20.31,354454 (UTC), sisestab investeerimisühing Y uue ostukorralduse samal hinnatasemel, ent suuremale kogusele (325 aktsiat) (2. sündmus). Selles kauplemiskohas on suurema kogusega korraldustel prioriteetsus väiksema kogusega korralduste suhtes.

Koguse ning aja prioriteetsuse tõttu paigutatakse 325 aktsia korraldus tellimusraamatus 100 aktsia tellimusest ettepoole. Pädev asutus saab selle rekonstrueerida, arvestades kõigepealt prioriteetsuspõhist kogust ja seejärel prioriteetsuse ajatemplit korraldustel, millest igaühe korral on kauplemiskoht märkinud need vastavalt prioriteetsuse ajatempli ja prioriteetsuspõhise koguse väljale. Kui 325 aktsia korraldust muudetakse 27. juunil 2018 kell 11.20.35,325891 (UTC), vähendades kogust 90 aktsiale, kaotab see prioriteetsuse 100 aktsia korralduse suhtes. See korralduse muudatus tuleb märkida prioriteetsuse ajatempli väljale ja prioriteetsuspõhise koguse väljale (sündmus 3).

Eespool kirjeldatud juhtudel tuleks prioriteetsuse ajatempli väli ja prioriteetsuspõhise koguse väli täita iga korralduse ja korralduse muudatuse jaoks eraldi, st järgmiselt. Ülevaatlikkuse huvides on esitatud ainult väljad 13 ja 14, sest need on selle näite jaoks kõige olulisemad.

1. sündmus: 100 aktsia korralduse sisestamine

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber		
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T11:20:30.112121Z
14	Prioriteetsuspõhine kogus	100

2. sündmus: 325 aktsia korralduse sisestamine

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber		
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T11:20:31.354454Z
14	Prioriteetsuspõhine kogus	325

3. sündmus: 325 aktsia korralduse muutmine, vähendades kogust 90 aktsiale

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber		

13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T11:20:35.325891Z
14	Prioriteetsuspõhine kogus	90

6.13.8.3 Proportsionaalse sobitamisega kauplemissüsteem

139. näide

Investeerimisühing X sisestab 27. juunil 2018 kell 11.20.30,112121 (UTC) uue ostukorralduse 200 aktsiale määratud hinnaga 10 000 eurot proportsionaalse sobitamise algoritmi kasutavasse tellimusraamatusse, kus sissetuleva korralduse kogus jaotatakse kõigi ootel korralduste vahel proportsionaalselt nende järelejäänud kogustega.

Proportsionaalse sobitamise algoritme kasutavad kauplemiskohad võivad märkida prioriteetsuspõhise koguse väljale 14 väärtuse „0“ (null), kui nad on algoritmi üksikasjad avaldanud ja need võimaldavad pädevatel asutustel rekonstrueerida korralduste täitmise mehhanismi. Vastavalt sellele täidetakse väljad 13 ja 14 nii:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber		
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T11:20:30.112121Z
14	Prioriteetsuspõhine kogus	0

6.13.9 Kauplemisetapid

140. näide

Kauplemiskoht M teeb finantsinstrumendi avamisoksjoni, mis algab 27. juunil 2018 kell 07.50.00,425381 (UTC+1). Enne seda tellimusraamatus korraldusi ei ole. Indikatiivset oksjonihinda ei ole veel määratud, sest korraldusi ei ole ja indikatiivne oksjoni maht on 0 aktsiat (1. sündmus). Kell 07.55.21,528754 (UTC+1) esitab investeerimisühing X ostukorralduse 100 aktsiale hinnaga 1 euro (2. sündmus).

Kell 07.57.46,255897 (UTC+1) esitab investeerimisühing Y turule müügikorralduse 50 aktsiale. Sellega tekib tellimusraamatus tehingupaar ning tekivad vastavalt indikatiivne hind 1 euro ja indikatiivne kogus 50 aktsiat (3. sündmus). Kell 07.59.52,264547 (UTC+1) esitab ühing turule pakkumise 25 aktsiale. See ei mõjuta indikatiivset hinda, ent indikatiivne kogus suureneb 75 aktsiale (4. sündmus). Kell 08.00.25,149531 (UTC+1) sobitatakse korraldused oksjoni lõpus ning kaks müügikorraldust sisestatakse 3. ja 4. sündmusena ning kaubeldakse 2. sündmuse 2 all esitatud ostukorralduse vastu, misjärel väärtpaber läheb pidevale kauplemisele (5. sündmus). Kauplemisetapid esitatakse eraldi ridadel. Kauplemisetapi rida peab pärast igakordset muutmist säilima. Indikatiivne oksjonihind ja indikatiivne oksjonikogus esitatakse üheskoos eraldi real vastavalt iga väärtuse muutumisele ja muudatuse ajale.

1. sündmus: avamisoksjon

1. rida peab sisaldama alljärgnevat teavet ja kõik teised väljad jäetakse tühjaks (sh väli 50 (indikatiivne oksjoni hind) ja väli 51 (indikatiivne oksjoni maht), sest need väljad ei ole kauplemisetapi muutumise kajastamiseks nõutavad). Täita tuleb üksnes järgmised väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
15	Järjenumber	20056	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
16	Segmendi MIC	XMIC	
17	Tellimusraamatu tunnuskood	XYZ9876	
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000	
20	Korralduse tunnuskood		Tühi, sest tegu on kauplemisetapi muutusega.
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine		
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid	Avamisoksjon	

Et avamisoksjon on alanud, peaks indikatiivse oksjoni hinna väli olema tühi, näidates indikatiivse oksjoni hinna määramatust, ning indikatiivne oksjoni maht peaks olema 0. Seega tuleks kogu nimetatud teave esitada 2. real ja jätta kõik ülejäänud väljad tühjaks. Täita tuleb üksnes järgmised väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T06:50:00.425381Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
15	Järjenumber	20068	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
16	Segmendi MIC	XMIC	

17	Tellimusraamatu tunnuskood	XYZ9876	
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000	
20	Korralduse tunnuskood		Tühi, sest tegu on indikatiivse hinna ja koguse muutusega.
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest hinda ei ole määratud.
51	Indikatiivne oksjoni maht	0	Oksjonimaht puudub.

2. sündmus:100 aktsia korralduse sisestamine

3. andmerida sisaldab uue korralduse kirjet vastavalt järgmisele (kõiki korralduse kirje välju ei ole esitatud):

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T06:55:21.528754Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T06:55:21.528754Z	
15	Järjenumber	20075	
F jagu – korralduse tunnuskood			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	1	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
36	Algne kogus	100	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	100	
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
51	Indikatiivne oksjoni maht		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

3. sündmus: 50 aktsia uue korralduse sisestamine

4. andmerida sisaldab uue korralduse kirjet vastavalt järgmisele (kõiki korralduse kirje välju ei ole esitatud):

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T06:57:46.255897Z	
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T06:57:46.255897Z	
15	Järjenumber	20089	
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	987654321DEF	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind		Tühi, sest turukorraldusel puudub hind.
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	
36	Algne kogus	50	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	50	
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
51	Indikatiivne oksjoni maht		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

5. andmerida näitab indikatiivse oksjoni hinna ja indikatiivse oksjoni mahu mõju eespool kirjeldatud korralduse kirjele, kusjuures kõik teised väljad on tühjad. Täita tuleb üksnes järgmised väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T06:57:46.255897Z	Muutumatu
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
15	Järjenumber	20095	Sellel sündmusel on muu järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
16	Segmendi MIC	XMIC	
17	Tellimusraamatu tunnuskood	XYZ9876	
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000	
20	Korralduse tunnuskood		Tühi, sest tegu on indikatiivse hinna ja koguse muutusega.
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
50	Indikatiivne oksjoni hind	1	
51	Indikatiivne oksjoni maht	50	

4. sündmus:25 aktsia uue korralduse sisestamine

6. andmerida sisaldab uue korralduse kirjet vastavalt järgmisele (kõiki korralduse kirje välju ei ole esitatud):

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Korralduse sisestamise aeg.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Sama kui sisestamise aeg.
15	Järjenumber	20156	Sellel sündmusel on muu järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	543216789GHI	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	NEWO	

I jagu – hinnad			
24	Määratud hind		Tühi, sest turukorraldusel puudub hind.
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	
36	Algne kogus	25	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	25	
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
51	Indikatiivne oksjoni maht		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

7. andmerida näitab indikatiivse oksjoni hinna ja indikatiivse oksjoni mahu mõju, kusjuures kõik teised väljad on tühjad. Täita tuleb üksnes järgmised väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T06:59:52.264547Z	Muutumatu
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
15	Järjenumber	20157	Sellel sündmusel on muu järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
16	Segmendi MIC	XMIC	
17	Tellimusraamatu tunnuskood	XYZ9876	
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000	
20	Korralduse tunnuskood		Tühi, sest tegu on indikatiivse hinna ja koguse muutusega.
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
50	Indikatiivne oksjoni hind	1	Oksjonihind on muutumatu, £1.
51	Indikatiivne oksjoni maht	75	Maht on 75 aktsiat.

5. sündmus: oksjoni sobitamine ja pidevkauplemise algus

8. andmerida näitab, et 100 aktsia ostukorraldus on 50 aktsiaga osaliselt täidetud (kõiki korralduse välju ei ole esitatud):

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Osalise täitmise aeg.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T06:55:21.528754Z	Sama kui sisestamise aeg, sest korraldus on veel aktiivne.
15	Järjenumber	20189	Sellel sündmusel on muu järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	PARF	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	1	
28	Tehinguhind	1	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
36	Algne kogus	100	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	50	
39	Kaubeldud kogus	50	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	ABC123456	
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
51	Indikatiivne oksjoni maht		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

9. andmerida näitab, et 50 aktsia müügikorraldus on 50 aktsiaga täidetud (kõiki korralduse välju ei ole esitatud):

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Täitmise aeg.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel		Tühi, sest korraldus ei ole enam aktiivne.
15	Järjenumber	20190	Sellel sündmusel on muu järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	987654321DEF	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind		Tühi, sest turukorraldusel puudub hind.
28	Tehinguhind	1	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	
36	Algne kogus	50	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	0	
39	Kaubeldud kogus	50	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	ABC123456	
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
51	Indikatiivne oksjoni maht		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

10. andmerida näitab, et 50 aktsia ostukorraldus on 25 aktsiaga osaliselt täidetud (kõiki korralduse välju ei ole esitatud):

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Osalise täitmise aeg.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel	2018-06-27T06:55:21.528754Z	Sama kui sisestamise aeg.
15	Järjenumber	20256	Sellel sündmusel on muu järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	PARF	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind	1	
28	Tehinguhind	1	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI	
36	Algne kogus	100	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	25	
39	Kaubeldud kogus	25	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	DEF9876	
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
51	Indikatiivne oksjoni maht		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

11. andmerida näitab, et 25 aktsia müügikorraldus on 25 aktsiaga täidetud (kõiki korralduse välju ei ole esitatud):

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Täitmise aeg.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
13	Prioriteetsuse ajatempel		Tühi, sest korraldus on täidetud.
15	Järjenumber	20257	Sellel sündmusel on muu järjenumber.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
20	Korralduse tunnuskood	543216789GHI	
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused			
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL	
I jagu – hinnad			
24	Määratud hind		Tühi, sest turukorraldusel puudub hind.
28	Tehinguhind	1	
J jagu – korraldusega seotud juhised			
32	Ostu-müüginäitaja	SELL	
36	Algne kogus	25	
37	Järelejäänud kogus, sealhulgas varjatud kogus	0	
39	Kaubeldud kogus	25	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	DEF9876	
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
50	Indikatiivne oksjoni hind		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.
51	Indikatiivne oksjoni maht		Tühi, sest ei ole selle sündmuse puhul nõutav.

Kauplemisetapi muutus tuleks kajastada säilitatavates andmetes eraldi andmereal. Seetõttu sisaldab 12. rida järgmist teavet, kusjuures kõik teised väljad on tühjad. Täita tuleb üksnes järgmised väljad:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks	Kirjeldus (kui asjakohane)
C jagu – kuupäev ja kellaaeg			
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T07:00:25.149531Z	Ajatempel ajalise detailsusega 1 mikrosekund.
E jagu – prioriteetsus ja järjenumber			
15	Järjenumber	20258	Selle sündmuse järjenumber kauplemiskohas.
F jagu – korralduse tunnusandmed			
16	Segmendi MIC	XMIC	Muutumatu
17	Tellimusraamatu tunnuskood	XYZ9876	Muutumatu
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000	Muutumatu
20	Korralduse tunnuskood		Tühi, sest tegu on kauplemisetapi muutusega.
K jagu – kauplemisetapid, indikatiivne oksjoni hind ja maht			
49	Kauplemisetapid	Pidevkauplemine	Pidevkauplemine on alanud.

6.14 Noteeringutaotluse süsteemid

Noteeringutaotluse süsteemis antakse vastuseks ühe või mitme liikme või osalise taotlusele noteering või noteeringud. Noteeringu alusel saab tehingu teha üksnes taotlev liige või osaline. Taotlev liige või osaline võib talle esitatud noteeringuga nõustuda või mitte. Noteeringuga nõustumine võib teatud vastaspoolte vahel toimuda automaatselt.

Noteeringutaotluse süsteemil on eriomadused. Nende eriomadustega seotud asjakohaste andmete säilitamiseks tuleb väljade tabel täita ettenähtud viisil. Seetõttu on allpool näited noteeringutaotluse süsteemi järgmiste eriomaduste kohta:

141. näide: kuidas registreerida noteeringutaotlus, mis on saadetud konkreetsetele vastaspooltele?
142. näide: kuidas registreerida piiratud kehtivusajaga („rippumisaeg“) noteering, mille alusel saab tehingu teha üksnes konkreetne noteeringu taotleja?
143. näide: kuidas registreerida noteering, mille kogus erineb taotletust?
144. näide: kuidas registreerida noteeringutaotluse süsteemis täitmine?

6.14.1 Kuidas registreerida noteeringutaotlus, mis on saadetud konkreetsetele vastaspooltele?

Noteeringutaotlus tuleks sisestada uue korraldusena, märkides korralduse tunnuskoodi ning märkides korralduse sündmuseks (väli 21) 'RFQS'. Selle järgi saab tuvastada, et tegu on esitatud noteeringutaotlusega.

Lisaks tuleks registreerida, kas noteeringutaotlus on saadetud kogu turule või konkreetsetele vastaspooltele. Selleks tuleks kasutada suunamisstrateegia välja (väli 47). Suunamisstrateegia andmeväli tuleks jätta tühjaks, kui noteeringutaotlus saadeti kõigile kauplemiskoha liikmetele. Samas kui noteeringutaotlus esitati konkreetsele ühingule, tuleks suunamisstrateegia andmeväljale märkida LEI. Kui noteeringutaotlus saadeti mitmele ühingule, tuleks iga ühingu kohta avada uus andmeväljade tabel (märkides suunamisstrateegia andmeväljale vastava LEI), kuid korralduse tunnuskood peaks kõigil olema sama.

141. näide

Investeerimisühing X avaldab noteeringutaotluse süsteemiga kauplemiskohas 27. juunil 2018 kell 13.05.10 (UTC) huvi müüa konkreetset instrumenti (ISIN XX0000000000) ning taotleb selleks ühepoolset noteeringut instrumendi müügiks konkreetses koguses (1000) liikmetele, kes tema noteeringutaotlusele vastavad. Noteeringutaotlus saadetakse kahele konkreetsele liikmele: investeerimisühingule Y (LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) ja investeerimisühingule Z (LEI KLMNOPQRST1234567890). Kuidas peaks noteeringutaotluste süsteemiga kauplemiskoht kajastama seda andmeväljade tabelis?

a) Noteeringutaotlus investeerimisühingult X investeerimisühingule Y:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed		
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	12345678901234567890
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T13:05:10Z
F jagu – korralduse tunnusandmed		
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	RFQS[48]

[48] Seda koodi ei ole komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/580 mainitud, kuid see sobib vaba vorminguga {ALPHANUM-4} väljale. Samas eeldatakse, et kauplemiskohad kasutavad seda koodi üksnes sellel konkreetsel juhul.

J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	SELL
36	Algne kogus	1000
47	Suunamisstrateegia	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST

b) Noteeringutaotlus investeerimisühingule Z (kus andmeväljade tabel täidetakse täpselt samamoodi kui eelmine (sh korralduse tunnuskood on sama), ainus erinevus on, et suunamisstrateegia andmeväljale märgitakse investeerimisühingu Z LEI).

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
F jagu – korralduse tunnusandmed		
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
J jagu – korraldusega seotud juhised		
47	Suunamisstrateegia	KLMNOPQRST1234567890

Noteeringute uuendamine: vt punkt 6.13.1.2.

6.14.2 Kuidas registreerida piiratud kehtivusajaga („rippumisaeg“) noteering, mille alusel saab tehingu teha konkreetne noteeringu taotleja

142. näide

Investeerimisühing Y vastab 141. näites märgitud investeerimisühingu X noteeringutaotlusele, andes 27. juunil 2018 kell 13.06.07 (UTC) vastuseks ühepoolse (ostu)noteeringu instrumendi (ISIN XX0000000000) taotletud kogusele (1000) hinnaga 8,750 eurot ja kehtivusajaga 10 minutit, mille alusel saab tehingu teha noteeringu taotleja investeerimisühing X. Noteeringuvastus on tuvastatav korralduse sündmuse väljal (väli 21) oleva märke ‘RFQR’ järgi. Noteeringu taotleja ja noteeringuvastuse andja seostamiseks märgitakse tehingupiirangute väljale (väli 11) korralduse tunnuskood, mille all noteeringutaotluste süsteemiga kauplemiskoht on vastava noteeringutaotluse registreerinud (vt 141. näide).

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed		
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST
C jagu – kuupäev ja kellaaeg		
9	Kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T13:06:07Z
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
10	Kehtivusaeg	GTSV
11	Tehingupiirangud	123456789ABC

12	Kehtivusaja kuupäev ja kellaaeg	2018-06-27T13:16:07Z
F jagu – korralduse tunnusandmed		
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000
20	Korralduse tunnuskood	23456789DEF
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	RFQR[49]
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	8,750
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI
36	Algne kogus	1000

6.14.3 Kuidas registreerida noteering, mille kogus erineb taotletust

143. näide

Investeerimisühing Z vastab 141. näite noteeringutaotlusele, andes vastuseks ühepoolse (ostu)noteeringu hinnaga 8,750 eurot taotletud kogusest erinevale instrumendi (ISIN XX0000000000) kogusele (investeerimisühing X taotles 1000, investeerimisühingu Z vastuses on 600), mille alusel saab tehingu teha noteeringu taotleja investeerimisühing X. Noteeringu taotleja ja noteeringuvastuse andja seostamiseks märgitakse tehingupiirangute väljale (väli 11) korralduse tunnuskood, mille all noteeringutaotluste süsteemiga kauplemiskoht on vastava noteeringutaotluse registreerinud (vt 141. näide).

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed		
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	KLMNOPQRST1234567890

[49] Seda koodi ei ole komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/580 mainitud, kuid see sobib vaba vorminguga {ALPHANUM-4} väljale. Samas eeldatakse, et kauplemiskohad kasutavad seda koodi üksnes sellel konkreetsel juhul.

D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
11	Tehingupiirangud	123456789ABC
F jagu – korralduse tunnusandmed		
18	Finantsinstrumendi tunnuskood	XX0000000000
20	Korralduse tunnuskood	78901223GHI
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	RFQR[50]
H jagu – korralduse liik		
22	Korralduse liik	Määratud hinnaga
23	Korralduse liigitus	LMTO
I jagu – hinnad		
24	Määratud hind	8,750
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI
36	Algne kogus	600

6.14.4 Kuidas registreerida noteeringutaotluse süsteemis täitmine

144. näide

Noteeringu taotleja investeerimisühing X täidab 142. näites esitatud investeerimisühingu Y noteeringuvastuse. Sellest tulenev tehing kajastatakse noteeringu taotleja investeerimisühingu X ja noteeringuvastuse andja investeerimisühingu Y vahelise kahe täitmissündmusena. Mõlema sündmuse korral tuleks märkida kauplemiskoha tehingu tunnuskood (väli 48), et kajastada tehingu aluseks olevat kaht noteeringut. Sellega on tagatud täielik auditijälg noteeringutaotlusest noteeringuvastuse ja vastava tehinguni. Esimene tabel kajastab noteeringutaotluse täitmise sündmust investeerimisühingu X vaatepunktist:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed		
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	12345678901234567890
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
11	Tehingupiirangud	

[50] Seda koodi ei ole komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/580 mainitud, kuid see sobib vaba vorminguga {ALPHANUM-4} väljale. Samas eeldatakse, et kauplemiskohad kasutavad seda koodi üksnes sellel konkreetsel juhul.

F jagu – korralduse tunnuskood		
20	Korralduse tunnuskood	123456789ABC
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasi-lükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL
I jagu – hinnad		
28	Tehinguhind	8,750
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	SELL
39	Kaubeldud kogus	1000
47	Suunamisstrateegia	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	GHIJ1234

Teine tabel kajastab noteeringutaotluse täitmise sündmust investeerimisühingu Y vaatepunktist:

Nr	Andmeväli	Standardid ja vormingud pädevale asutusele taotluse korral korralduste andmete esitamiseks
A jagu – asjaomaste poolte tunnusandmed		
1	Korralduse esitanud üksuse tunnusandmed	ABCDEFGHIJKLMNOPQRST
D jagu – kehtivusaeg ja tehingupiirangud		
11	Tehingupiirangud	123456789ABC
F jagu – korralduse tunnuskood		
20	Korralduse tunnuskood	23456789DEF
G jagu – korraldust mõjutavad sündmused		
21	Uus korraldus, korralduse muutmine, korralduse tühistamine, korralduse tagasilükkamine, osaline või täielik täitmine	FILL
I jagu – hinnad		
28	Tehinguhind	8,750
J jagu – korraldusega seotud juhised		
32	Ostu-müüginäitaja	BUYI
39	Kaubeldud kogus	1000
47	Suunamisstrateegia	
48	Kauplemiskoha tehingu tunnuskood	GHIJ1234

7 Kellade sünkroonimise suunised

Kauplemiskohtadele ning nende liikmetele ja osalistele kohaldatakse MiFID II artiklit 50 ja seonduvaid regulatiivseid tehnilisi standardeid, mis kohustavad neid järgima täpsusnõudeid seoses äritegevuses kasutatavate kellade maksimaalse erinevusega koordineeritud maailmaajast (UTC) ning varustama teatamisele kuuluvad sündmused ettenähtud detailsusega ajatemplitega.

7.1 Teatamisele kuuluvad sündmused

MiFID II artikkel 50 käsitleb kauplemiskohtade ja nende liikmete/osaliste kohustust sünkroonida kellad, millega nad registreerivad oma äritegevuses „teatamisele kuuluvate sündmuste“ kuupäeva ja kellaaega. ESMA peab vajalikuks tuua artiklis 50 sätestatud „teatamisele kuuluvate sündmuste“ näiteid.

ESMA hinnangul hõlmab „teatamisele kuuluv sündmus“ kõiki järgmisi kohustusi:

- kauplemise aja ja avalikustamise aja avaldamine vastavalt aktsiate, aktsialaadsete instrumentide ja mittekapitaliväärtpaberite läbipaistvust käsitlevatele RTS 1 I lisa tabelile 3 ja RTS 2 tabeli 1b II lisale MiFIRi artiklite 6, 7, 10 ja 11 alusel;

- kauplemise aega käsitlev tehinguaruandlus vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 väljale 28 MiFIRi artikli 26 alusel;

- investeerimisühingute korraldusi ja tehinguid mõjutavate sündmuste ajaarvestuse pidamine MiFIRi artikli 25 lõike 1 alusel ning MiFIDi artikli 6 lõikest 6 tulenevad andmete säilitamise nõuded (v.a telefonikõned ja muu elektrooniline side) vastavalt komisjoni 25. aprilli 2016. aasta delegeeritud määruse (EL) 2017/565 artiklile 74 (MiFID II artikli 16 lõike 6 nõuded);

- korraldusi mõjutavate sündmuste ajaarvestus vastavalt RTS 6 II lisa tabeli 2 väljale 27 ning tabeli 3 väljadele 23, 24 ja 33 kooskõlas MiFID II artikli 17 lõikega 2 investeerimisühingutes, kes kasutavad algoritmipõhiseid välkkauplemistehnikaid;

- korraldusi mõjutavate sündmuste ajaarvestus vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 väljadele 9, 12 ja 13 MiFIRi artikli 25 lõike 2 alusel.

7.2 Ajatemplite detailsus

MiFID II artiklit 50 kohaldatakse mitmesuguste teatamisele kuuluvate sündmuste suhtes (vt punkt 7.1). Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/574 sätestab kaht liiki täpsusnõuded: maksimaalne erinevus koordineeritud maailmaajast (UTC) ning ajatemplite detailsus. Suuniste see osa käsitleb üksnes viimast.

NB! MiFID II artiklit 50 kohaldatakse üksnes teatamisele kuuluvate sündmuste suhtes, mis toimuvad kauplemiskohas. Seda ei kohaldata näiteks börsivälistele tehingutele.

Kauplemiskoha liige või osaline ei pea järgima samu ajatemplite nõuded, mis kehtivad kauplemiskohale, mille liige või osaline ta on. Liige või osaline peab kasutama ajatempleid üksnes vastavalt nõuetele, mis kehtivad tema ühingu kauplemistegevusele tulenevalt MiFID II artiklist 50.

Kui tehing sooritatakse investeerimisühingute ahela kaudu (algne korraldus edastatakse ahelas ühelt investeerimisühingult teisele), peaks iga ahelasse kuuluv investeerimisühing järgima tema enda

kauplemistegevusele kehtivaid ajatemplite kasutamise nõudeid, olenemata sellest, mis ajatemplite kasutamise nõudeid kohaldatakse ahela teistele investeerimisühingutele.

MiFIRi artikkel 26 ja MiFID II artikli 16 lõige 6 – tehinguaruandlus ning tehingute ja korralduste töötlemise arvestuse pidamine

7.2.1.1 Kauplemiskohas sooritatavad tehingud

Kui investeerimisühing sooritab tehingu kauplemiskohas (nt kauplemiskoha liikme või osalisena), peaks ta täitma tehinguaruande kauplemise kuupäeva ja kellaaja välja vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 järgi kauplemiskohas sooritatud tehingutele kehtivatele ajalise detailsuse nõuetele. Seda kirjeldatakse käesolevate suuniste I osa punktis 5.4 „Tehingu sooritamine kauplemiskohas“. Ka MiFID II artikli 16 lõike 6 nõuete alla kuuluvad investeerimisühingud peaksid registreerima kauplemiskohtades tehtud tehingute ja kauplemiskohtadele esitatud korralduste aja vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 ajalise detailsuse nõuetele.

7.2.1.2 Tehingud, mida ei sooritata kauplemiskohas

Kõik investeerimisühingud (olenemata sellest, kas nad on kauplemiskoha liikmed või osalised või mitte) peaksid kasutama mujal kui kauplemiskohas toimuvate tehingute aruannetes sekundi detailsusega või täpsemaid ajatempleid vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabeli 2 väljale 28. Ka MiFID II artikli 16 lõike 6 nõuete alla kuuluvad investeerimisühingud peaksid registreerima väljaspool kauplemiskohti sooritatud tehingute ja väljaspool kauplemiskohti esitatud korralduste aja sekundi täpsusega.

Kui tehingut ei sooritata kauplemiskohas (st tehing on börsiväline), märgitakse komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 kohaselt kuupäev ja kellaaeg tehinguaruandesse vastavalt sellele, „millal pooled lepivad kokku teatud väljade sisu“.

7.2.1.3 Näited

Alljärgnevad näited illustreerivad ajatemplite kasutamist korralduste andmetes ja tehinguaruannetes. NB! UTC+1 kellaajad tuleb parandada ajatemplites UTC-ks. Järgmistes näidetes eeldatakse, et investeerimisühing X ja investeerimisühing Y on investeerimisühingud, kellel on MiFIRi artiklist 26 tulenevad aruandluskohustused.

145. näide Korraldused ja tehingud kauplemiskohas

Investeerimisühing X saab 20. juunil 2018 kell 12.11.38,077312 (UTC+1) kliendilt elektroonilise sõnumiga korralduse rahalisele kapitaliinstrumendile. Investeerimisühing X töötleb seda sõnumit automaatselt ning kasutab algoritmi, mis esitab korralduse kauplemiskohale M kell 12.11.38,236931 (UTC+1). Korraldus saabub kauplemiskohta M kell 12.11.38,478598 (UTC+1) (1. korraldus). Investeerimisühing X kasutas selle korralduse jaoks algoritmipõhist välkkauplemistehnikat MiFID II direktiivi (EL) 2014/65 artikli 4 lõike 1 punkti 40 tähenduses.

Investeerimisühing Y esitab 20. juunil 2018 kell 13.42.29,327087 (UTC+1) kauplemiskohale M korralduse rahalisele kapitaliinstrumendile. Korraldus saabub kauplemiskohta M kell 13.42.29,561123 (UTC+1) (2. korraldus). Investeerimisühing Y kasutas elektroonilist süsteemi, mis MiFID II direktiivi (EL) 2014/65 artikli 4 lõike 1 punkti 40 määratluse alla ei kuulu.

Kauplemiskoha M elektroonilise sobitamissüsteemi lüüsidevaheline latentsusaeg on 350 mikrosekundit.

MiFIRi artikkel 25 ja MiFID II artikkel 17 – tehinguandmete arvestuse pidamine

Kauplemiskoht M peaks registreerima korralduse sündmuse mikrosekundi detailsusega või täpsemalt, sest tema lüüsidevaheline latentsusaeg on alla 1 millisekundi. 1. korralduse jaoks tuleks komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 väljale 9 märkida 2018-06-20T11:11:38.478598Z ja 2. korralduse jaoks tuleks komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 väljale 9 märkida 2018-06-20T12:42:29.561123Z.

Investeerimisühing X peaks registreerima korralduse sündmuse mikrosekundi detailsusega või täpsemalt, sest investeerimisühingu X tegevus toimus algoritmipõhist välkkauplemistehnikat kasutades (vt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 tabel 2). Kliendi korralduse saabumise ajatempel peaks olema 2018-06-20T11:11:38.077312Z. Korralduse kauplemiskohale esitamise ajatempel peaks olema 2018-06-20T11:11:38.236931Z.

Investeerimisühing Y peaks registreerima korralduse sündmuse millisekundi detailsusega või täpsemalt, sest tegevus toimus elektroonilises kauplemises, mis kuulub komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 tabeli 2 viimase rea alla (mis tahes muu kauplemistegevus). Ajatempel peaks olema 2018-06-20T12:42:29.327Z.

MiFIRi artikkel 26 – tehinguaruandlus

Kui investeerimisühingu X ja investeerimisühingu Y korraldused täideti kauplemiskohas M, peaks ühingutel X ja Y mõlemal olema mõlemal tehinguaruande esitamise kohustus.

Investeerimisühing X peaks turul täitmist kajastavas tehinguaruandes täitma komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 välja 28 (kauplemise kuupäev ja aeg) mikrosekundi detailsusega või täpsemalt. Investeerimisühing Y peaks turul täitmist kajastava tehinguaruande täitma millisekundi detailsusega või täpsemalt.

146. näide Tehingud, mida ei sooritata kauplemiskohas

145. näide jätkub: Eeldades, et investeerimisühing X omandas rahalise kapitaliinstrumendi kauplemiskohas M ja investeerimisühing X müüs instrumendi seejärel edasi oma kliendile, peaks investeerimisühingul X olema tehinguaruande esitamise kohustus. Vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 tabeli 2 väljale 28 (kauplemise kuupäev ja aeg) peaks investeerimisühing X märkima kauplemise kuupäeva ja kellaaja tehinguaruandesse sekundi detailsusega või täpsemalt.

147. näide Korraldused ja tehingud kauplemiskohas

Investeerimisühing X esitab kauplemiskohale A 20. juunil 2018 kell 15.01.25,369310 (UTC+1) korralduse globaalsele hoidmistunnistusele ning see saabub kauplemiskohta A kell 15.01.25,458482.

Siin näites kasutatakse kauplemiskohas A teistsugust elektroonilist sobitamissüsteemi kui 116. näites. Sobitamissüsteemi lüüsidevaheline latentsusaeg on 1,2 millisekundit.

Investeerimisühing X kasutas korralduse esitamiseks elektroonilist süsteemi, mis MiFID II artikli 4 lõike 1 punkti 40 määratluse alla ei kuulu.

MiFIRi artikkel 25 ja MiFID II artikkel 17 – tehinguandmete arvestuse pidamine

Kauplemiskoht A peaks registreerima korralduse sündmuse millisekundi detailsusega või täpsemalt, sest tema lüüsidevaheline latentsusaeg on üle 1 millisekundi. komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 väljale 9 tuleks märkida 2018-06-20T14:01:25.458Z.

Investeerimisühing Y peaks registreerima korralduse sündmuse millisekundi detailsusega või täpsemalt, sest tegevus toimus elektroonilises kauplemises, mis kuulub komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 tabeli 2 viimase rea alla (mis tahes muu kauplemistegevus). Ajatempel peaks olema 2018-06-20T14:01:25.369Z.

MiFIRi artikkel 26 – tehinguaruandlus

Kui investeerimisühingu X korraldus täideti kauplemiskohas A, peaks investeerimisühing X turul täitmist kajastavas tehinguaruandes täitma komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 välja 28 (kauplemise kuupäev ja aeg) mikrosekundi detailsusega või täpsemalt.

Ahela korral, kus lõplik täitmine toimub kauplemiskohas, tuleb komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artikli 3 detailsusega esitada üksnes kauplemiskoha turupoole aruanne ning teised aruanded peavad olema sekundi detailsusega, ehkki aruannetes võib kasutada ka suuremat ajalist detailsust. Investeerimisühingud, kes esitavad korraldusi teistele investeerimisühingutele, võivad esitada kauplemise kuupäeva ja aja väljal täitmisaja, mille täitev ühing teatas neile hääl- või elektroonilise sõnumiga.

7.3 Maksimaalset kõrvalekaldumist käsitlevate nõuete täitmine

Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/574 sätestab kaht liiki täpsusnõuded: suurim erinevus koordineeritud maailmaajast (UTC) ning ajatemplite detailsus. Suuniste see osa käsitleb üksnes esimest. Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklis 4 märgitakse: „Kauplemiskohtade korraldajad ja nende liikmed või osalised kehtestavad koordineeritud maailmaajas jälgitavuse.“ Muu hulgas tuleb tagada, et nende süsteemid töötaksid komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 kohase ajalise detailsuse ning suurima lubatud erinevusega koordineeritud maailmaajast. Lisaks peaksid kauplemiskohtade korraldajad ning nende liikmed ja osalised tõendama, et kasutatavad kriitilised süsteemiosad vastavad ajalise detailsuse ja koordineeritud maailmaajast suurima erinevuse nõuetele, mida peab tagama ja eritlema nimetatud süsteemiosade tootja (osade tehnilised kirjeldused peaksid vastama nõutavatele täpsustasemetele), ning nimetatud süsteemiosad on paigaldatud vastavalt tootja paigaldusjuhisele.

Tuleks nõuda süsteemi sobivat ja proportsionaalset katsetamist ning sobivat ja proportsionaalset seiret, et tagada koordineeritud maailmaajast erinevuse püsimine lubatud piires. Sobivus ja proportsionaalsus sõltuvad sellest, kui suur on kohaldatav suurim erinevus koordineeritud maailmaajast.

Vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklile 1 loetakse teatamisele kuuluvate sündmuste jaoks sobivateks süsteemid, mis võimaldavad vahetut jälgitavust koordineeritud maailmaaja suhtes, mille teatavad ja mille eest hoolitsevad kellaajakeskused, mille loetelu on esitatud Rahvusvahelise Kaalude ja Mõõtude Büroo värskeimas kellaajategevuste aastaaruandes. Teatamisele kuuluvate sündmuste registreerimiseks tohib kasutada ka USA globaalse positsioneerimissüsteemi (GPS) või muu globaalse satelliitnavigatsioonisüsteemi, näiteks Venemaa GLONASS või, pärast selle kasutuselevõtmist, Euroopa Galileo satelliidisüsteemi ajaallikat, kui arvestatakse selle erinevust koordineeritud maailmaajast ning see ajatemplis korrigeeritakse. GPS-aeg erineb koordineeritud maailmaajast. Samas sisaldab ka GPSi ajasõnum erinevust koordineeritud maailmaajast (liigsekundid)

ning see erinevus tuleb kombineerida GPSi ajatempliga, et saada komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 suurima erinevuse nõuetele vastav ajatempel. Selliste süsteemide kasutajad peaksid teadma nende kasutamise riskidest, näiteks päikesepursked, häiringud, segamine ja peegeldused eri trajektooridelt, ning tagama, et vastuvõtja on õigesti signaalile lukustatud. Seega tuleb võtta sobivad meetmed nende riskide minimeerimiseks. Eelkõige peaksid isikud, kes kavatsevad kasutada rangemate täpsusnõuete alla kuuluvaid GPS-vastuvõtjaid, arvestama Rahvusvahelise Telekommunikatsiooni Liidu raadiosidesektori (ITU-R) soovitust TF.1876 usaldusväärse ajaallika kohta.[51]

Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artikli 4 kohaldamisel satelliidisüsteemi kasutajatele tuleks määrusega ette nähtud täpsust rakendada kõigis domeenisüsteemi piiresse jäävates punktides, kus aega mõõdetakse. Esimene punkt, kus tuleks arvestada süsteemi ülesehitust, toimimist ja tehnilist kirjeldust, on siiski kasutatav vastuvõtja (st GPS-vastuvõtja mudel ja GPS-vastuvõtja projekteeritud täpsus), millega saadakse ajatempli sõnum satelliidilt (ja selle antenn, kui olemas). See ei peaks hõlmama GPS-süsteemi ja satelliitide jälgitavust koordineeritud mailmaaja suhtes.

7.3.1 Liigsekundid

Kui koordineeritud maailmaajale on vaja lisada või sellest lahutada liigsekund, nagu Rahvusvaheline Maa Pöörlemise ning Tugisüsteemide Teenistus (IERS) seda aeg-ajalt nõuab, tuleks see korraldada vastavalt Rahvusvahelise Telekommunikatsiooni Liidu raadiosidesektori (ITU-R) soovitusele TF.460-6. Soovituses märgitakse, et positiivne liigsekund algab kell 23.59.60 ja lõpeb kell 00.00.00 ning negatiivse liigsekundi korral järgneb kellaajale 23.59.58 kellaaeg 00.00.00.

7.3.2 Kohalik kellaaeg ja erinevus maailmaajast

Ajatempleid võib kasutada kohaliku kellaaja järgi, kui pädevale asutusele andmete esitamisel arvutatakse ajatempel ümber koordineeritud maailmaajaks. Mõni ajatemplisõnum võib koosneda ajatemplist ja erinevusest sellele ajatemplile kohaldatavast koordineeritud maailmaajast. Ka sel juhul tuleks pädevale asutusele esitatavates ajatemplites erinevust arvestada ning esitada pädevale asutusele ainult üks ajatempel.

7.3.3 Kohaldamine investeerimisühingutele, kes ei ole kauplemiskoha vahetud liikmed või osalised

MiFID II artiklit 50 kohaldatakse üksnes kauplemiskohtade liikmetele või osalistele. Samas kohaldatakse MiFIRi RTS 6 ja MiFID II artikli 16 lõike 6 nõudeid investeerimisühingutele olenemata sellest, kas nad tegutsevad kauplemiskoha liikmete või osalistena. Mõlema eeskirja suurima erinevuse nõudeid tuleks tõlgendada nii, et neid kohaldatakse investeerimisühingutele üksnes kauplemiskohtade liikmete või osalistena tegutsemisel, sest see vastab alusakti tekstis määratletud kohustuse kohaldamisalale.

7.4 Rakenduste, hostide ja liinide ajatemplid

Rakenduste ja hostide ajatemplid genereeritakse tarkvara abil ning liinide ajatemplid genereeritakse eraldi riistvara abil, lisades koopia asjaomast teavet sisaldavatest võrgupakettidest. ESMA hinnangul

[51] Soovitus TF.1876-0 (04/2010) aadressil https://www.itu.int/rec/R-REC-TF.1876-0-201004-I/en.

tohivad liikmed või osalised kasutada kõiki nimetatud ajatempleid. Kauplemiskohad peaksid arvestama, et sobitamissüsteemis sündmuste registreerimise nõuded eeldavad tõenäoliselt rakenduste ajatemplite kasutamist.

7.5 Lüüsidevaheline latentsusaeg

Kauplemiskohad võivad eri protsentiilide jaoks ette näha mitu eri lüüsidevahelist latentsusaega. Kellade sünkroonimisega seoses leiab ESMA, et kauplemiskohad peaksid kasutama 99. protsentiili lüüsidevahelist latentsusaega.

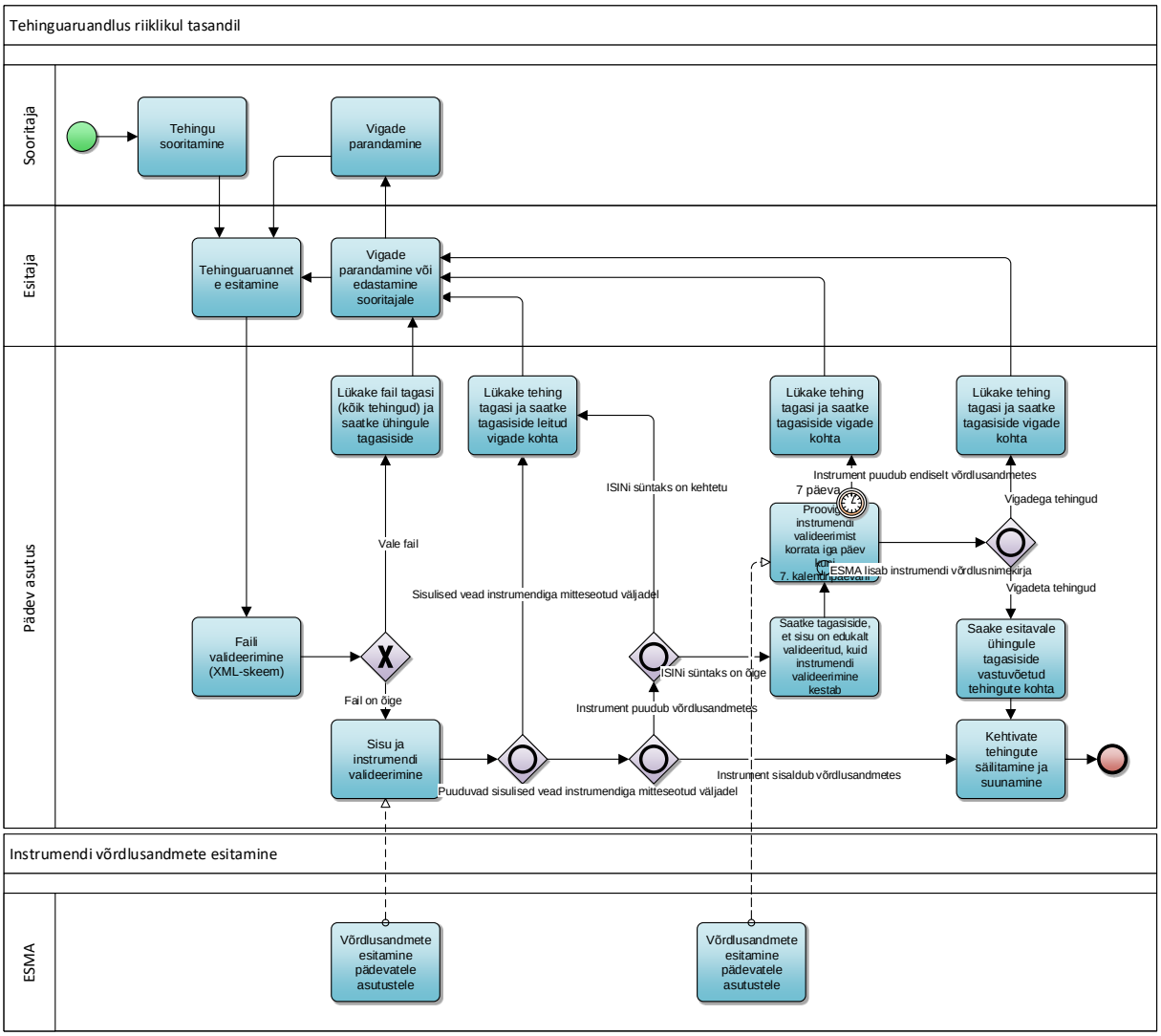
Kauplemiskohtadel on artikli 13 punkti c kohaselt kohustus jälgida lüüsidevahelist latentsusaega reaalajas (ESMA/2015/1464).[52] Nende artiklist 50 tulenevad ajalise detailsuse ja suurima erinevuse nõuded muutuvad, kui lüüsidevaheline latentsusaeg paraneb >1 millisekundilt ≤1 millisekundini. Selline stsenaarium tekib kõige tõenäolisemalt uue sobitamissüsteemi kasutuselevõtu või koha olemasoleva taristu tehnilise täiendamise järel, mistõttu tuleks ajatemplite nõudeid arvestada selliste tööde kavandamisel.

8 Lisad

I lisa. Esitajatelt saadud aruannete töötlemine

Alljärgnev skeem kujutab tehinguaruandluse protsessi riigisisesel tasandil.

[52] KOMISJONI 14. juuli 2016. aasta DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/584, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, milles määratakse kindlaks kauplemiskohtade organisatsioonilised nõuded.



Järgmises tabelis on protsessi võtmesündmuste tähtpäevade kokkuvõte.

Tähis	Ülesanne	Tähtpäev
T	Tehingu sooritamine	
R	Aruandluskohustuslane esitab tehinguaruanded	T+1 tööpäev
	Aruandluskohustuslasele tagasiside andmine	R+1 kalendripäev (R+7, kui instrument võrdlusandmetes puudub)

Päeval T sooritatud tehingute aruanded tuleb esitada hiljemalt järgmise tööpäeva (T+1) lõpuks.

Iga pädev asutus kehtestab oma äranägemisel aruannete esitamise üksikasjalikud tehnilised menetlused ja ajakavad.

Pädevad asutused peaksid saabuvad aruanded valideerima järgmiselt:

Failide valideerimine – failide XML-skeemile vastavuse kontroll (kogu faili ja konkreetsete tehinguaruannete süntaks). Kui fail on mittevastav, lükatakse tagasi kogu fail (kõik failis sisalduvad tehingud).

Sisu valideerimine – valideerimiseeskirjade kogum, mida kohaldatakse igale tehinguaruandele, et kontrollida konkreetsete andmeväljade sisu. Vigadega tehinguaruanded lükatakse tagasi, vigadeta tehinguaruandeid töödeldakse edasi järgmistel astmetel. Need valideerimiseeskirjad hõlmavad ka instrumendi võrdlusandmetest olenevat valideerimist.

Faile peaksid valideerima kõik pädevad asutused. Valideerimiseeskirjade alusel kontrollitakse XML-faili süntaksi õigsust.

Pärast faili edukat valideerimist tuleks rakendada sisu valideerimise reegleid igale failis sisalduvale tehingule. Sisueeskirjad hõlmavad eelkõige kontrolli, kas tehingu esemeks või selle aluseks olev instrument (teatud börsiväliste tehingute või Euroopa Liidu välisel organiseeritud kauplemisplatvormil tuletisinstrumentidega tehtavate tehingute korral) sisaldub võrdlusandmetes ning kas aruandes esitatud ISIN-koodi süntaks/kontrollnumber on õige. Võimalikud tulemused on järgmised:

tehinguaruanne on õige (kõik sisueeskirjad on täidetud) ja aruandes kajastatud instrument sisaldub võrdlusandmetes → tehinguaruanne võetakse vastu;

puuduvad sisulised vead muudel väljadel peale instrumendi/alusinstrumendi väljade, kuid aruandes kajastatud instrument puudub võrdlusandmetes ja aruandes esitatud ISINi süntaks/kontrollnumber on õige → tuleks teha järgmist:

pädev asutus peaks esitavale ühingule teatama, et tehinguks on nõutav instrumendi valideerimine;

pädev asutus peaks kordama instrumendi valideerimist iga päev kuni 7. kalendripäevani pärast esitavalt ühingult aruande saamist;

kui instrument ilmub võrdlusandmetesse enne 7 kalendripäeva möödumist ning instrumendi valideerimisel sisulisi vigu ei leita, võetakse tehing vastu;

kui instrument ilmub võrdlusandmetesse enne 7 kalendripäeva möödumist ning instrumendi valideerimisel leitakse sisulisi vigu, lükatakse tehing tagasi;

kui instrument pärast 7 päeva möödumist võrdlusandmetest endiselt puudub, lükkab pädev asutus tehinguaruande tagasi ja saadab esitavale ühingule vastava teate;

puuduvad sisulised vead muudel andmeväljadel peale instrumendi/alusinstrumendi väljade, kuid aruandes kajastatud instrument puudub võrdlusandmetes ja aruandes esitatud ISINi süntaks/kontrollnumber on vale → tehing lükatakse kohe tagasi;

esineb sisulisi vigu muudel andmeväljadel peale instrumendi/alusinstrumendi väljade → tehing lükatakse kohe tagasi, st 7 päeva ei oodata. Kõigi leitud vigade kohta tuleks anda tagasisidet.

Sisu valideeritakse üksnes failides, mis on edukalt läbinud faili valideerimise. Iga valideerimiseeskirja tuleks kohaldada igale failis sisalduvale tehinguaruandele.

Kui tehinguaruanne ei vasta ühele või mitmele valideerimiseeskirjale, lükatakse aruanne tagasi. Valideerimiseeskirjadele vastavad aruanded võetakse vastu. Võib juhtuda, et samas failis sisalduv mõni tehingukirje võetakse vastu, kuid mõni lükatakse tagasi. MiFIRi artikli 26 lõike 7 viimase lõigu põhjal peaks esitaja igale tagasilükkamisele viivitamata reageerima, et vead võimalikult kiiresti parandada. Päeval T sooritatud tehingute valideerimisel kasutavad pädevad asutused võrdlusandmeid päeva T seisuga. Tehingu- või võrdlusandmete hilisest esitamisest tulenevate probleemide lahendamiseks peaksid pädevad asutused pärast päeva T+1 valideeritavate või suunatavate tehingute korral kasutama uusimaid valideerimispäeval olemasolevaid võrdlusandmeid, nt kui tehing sooritati päeval T ja investeerimisühing esitas aruande päeval T+10, tuleks tehing valideerida vastavalt valideerimispäeval olemasolevatele uusimatele võrdlusandmetele.

Tagasisidefailid tuleks koostada ja esitajatele saata hiljemalt järgmisel päeval pärast aruande esitamist (R+1, kus R on aruande esitamise päev). See hõlmab nii esitatud tehinguaruannete õigsuse kinnitusi kui ka veateateid, kui esitatud tehinguaruannetes või kogu failis on vigu. Tehinguaruande tagasilükkamise korral tuleks tagasisidesõnumis märkida kasutatud valideerimiseeskiri ja vea olemus.