



19.5.2021

Julkinen

## MiFIR-kaupparaportoinnin tekninen ohje

1	Versiohistoria.....	2
2	Johdanto.....	2
3	Tietojen toimittaminen Finanssivalvonnalle.....	2
4	Kaupparaporttitiedoston kuvaus .....	2
4.1	Kaupparaporttitiedoston nimi.....	2
4.2	Tiedostopalautteen nimi .....	3
4.3	Päiväkohtaisen palautetiedoston nimi .....	3
4.4	Tiedostotason virhekoodit .....	3
4.5	Tiedoston otsikkotiedot.....	5
4.5.1	FF tiedostojen BizMsgldr-tunniste:.....	5
4.5.2	FD tiedostojen BizMsgldr.....	5
4.5.3	Palautetiedostojen MsgRptldr .....	6
5	Viitteet .....	7



## 1 Versiohistoria

Versio	Päivämäärä	Muutos
1.0	19.12.2017	Ensimmäinen versio
1.1	19.5.2021	Tietojen päivitys

## 2 Johdanto

Kaupparaportoinnin tekninen ohje täydentää ESMAn MiFIR reporting instructions[1] -dokumenttia kansallisesti ohjeistettavien asioiden osalta.

Kansallisesti ohjeistetaan tiedostojen nimeämiskäytännöt, yhteyskäytännöt, tiedoston otsikkotiedot ja tiedostotason virhekoodit.

## 3 Tietojen toimittaminen Finanssivalvonnalle

Tiedot toimitetaan Suomen Pankin tiedonkeruupalvelun kautta lomakkeella, verkkosivulla tiedoston siirrolla tai koneellisena tiedonvaihtona.

**Tuotantopalvelun osoite**  
**Testipalvelun osoite**

<https://dcs.bof.fi>  
<https://test.dcs.bof.fi>

## 4 Kaupparaporttiedoston kuvaus

Kaupparaporttiedostot ovat XML-tiedostoja ja koostuvat kauppatahtumista ja peruutustapahtumista.

Raportoinnissa käytettävä XML-skeemakuvaus löytyy ESMAn verkkosivuilta[1].

Raportointiesimerkkejä on kuvattu ESMAn kaupparaportointiohjeissa[2].

Kaupparaporttiedoston on noudatettava annettuja vaatimuksia, jotka koskevat

- Tiedostonimeä
- Tiedostotyyppiä (ZIP).

### 4.1 Kaupparaporttiedoston nimi

TR\_SEIC\_ORI\_YYYYMMDD\_RFSEQ.TYPE

Osio	Sisältö
TR	Tarkoittaa "Transaction Report"
SEIC	Submitting Entity Identification Code. 20 merkinen LEI-koodi (Legal Entity Identifier)
ORI	Tiedoston lähdejärjestelmä (Originating System). 2 numeroa.



	00 = Fivan TRSII-järjestelmä
	01...99 = Osasto tai järjestelmä raportojilla (SE). Numero yksi-löi lähdejärjestelmän tai osaston. Raportoijan valittavissa.
YYYYMMDD	Päivämäärä, jolloin raportoija (Submitting Entity) loi tiedoston
SEQ	Juokseva numero. 4 numeroinen järjestysnumero [0000-9999]. Alkaa nolasta päivittäin
TYPE	ZIP

#### 4.2 Tiedostopalautteen nimi

FF\_<Base name of received file>\_FFSEQ.TYPE

(esim. FF\_TR\_SEIC\_ORI\_YYYYMMDD\_SEQ\_FFSEQ.TYPE)

Tiedostokohtainen palaute (lähetetään kerran jokaiselle raportitiedos-tolle).

Segmentti	Sisältö
FF	Tarkoittaa "Feedback on File"
<Base name of received file>	Alkuperäisen tiedoston nimi tiedostopäätettä lukuun ottamatta
FFSEQ	Palautteen järjestysnumero

#### 4.3 Päiväkohtaisen palautetiedoston nimi

FD\_TR\_SEIC\_ORI\_YYYYMMDD\_FFSEQ.TYPE

Palaute kauppaportteille, jotka eivät ole saaneet Accepted ta Rejected palautetta (lähetetään kerran päivässä jokaiselle SEIC+ORI yhdistel-mälle).

Segmentti	Sisältö
FD	Tarkoittaa "Feedback, Daily"
YYYYMMDD	Päivämäärä, jolloin Fivan järjestelmä tuotti palautteen

#### 4.4 Tiedostotason virhekoodit

ErrorCode	ErrorMessage	ExplanationCorrectiveAction
FIX-001	File name has an illegal syntax.	Correct the filename so that it complies to the file name convention.
FIX-002	The date does not exist or is in the future.	Correct the date.
FIX-003	The file has already been submitted.	The duplicate file is ignored. If the file comprises new transaction reports, include them in a report file with a different sequence number.
FIX-004	The file has an illegal extension.	Correct the filename so that it complies to the file name convention.



19.5.2021

Julkinen

FIX-005	The file is larger than the allowed [x] MB.	Split the report file into two or more report files.
FIX-008	The file can't be decrypted.	Ensure that the file is properly encrypted. Check the encryption keys you are using or your encryption program. The encryption key might be outdated or unknown to us. Also make sure the correct hashing algorithm has been used.
FIX-009	The file can't be decompressed.	
FIX-010	The file is not properly signed.	Ensure that the file is properly signed. Check the keys you are using. The key might be outdated or unknown to us.
FIX-011	The SEIC is invalid.	Correct the SEIC in the file so that it is a valid legal entity identifier as defined in ISO 17442.
FIX-013	The recipient country, specified in the header, is incorrect.	Ensure that the recipient is the country code of the country of the CA to which the file is submitted.
FIX-014	The report file name is incorrect.	Correct the name of the compressed report file so that it matches the name of the archive file and has the proper extension.
FIX-015	The archive file does not contain only one report file.	Correct the contents of the archive file so that it contains only one report file.
FIX-016	The Submitting Entity is not authorised to report on behalf of the Executing Entity.	Ensure that it has been registered by the Executing Entity or the FSA that the Submitting Entity is authorised to report on behalf of the Executing Entity.



## 4.5 Tiedoston otsikkotiedot

### 4.5.1 FF tiedostojen BizMsgldr-tunniste:

<SEIC>\_<ORI><YYMMDD><RFSEQ><FFSEQ>

<SEIC>	<SEIC> osa palautetiedoston nimessä.
<ORI>	<ORI> osa palautetiedoston nimessä.
<YYMMDD>	<YYYYMMDD> osa palautetiedoston nimessä, josta vuosisata poistettu.
<RFSEQ>	<RFSEQ> osa palautetiedoston nimessä.
<FFSEQ>	<FFSEQ> osa palautetiedoston nimessä.

Esimerkki:

Palautetiedoston nimi:

FF\_TR\_12340012345678901269\_01\_20170407\_0092\_01.ZIP

<BizMsgldr>: 12340012345678901269\_01170407009201

(35 merkkiä)

### 4.5.2 FD tiedostojen BizMsgldr

Käytetään seuraavaa päivittäisen palautetiedoston nimessä johdettua tunnistetta:

<SEIC>\_<ORI><YYMMDD><FDSEQ>

<SEIC>	<SEIC> osa palautetiedoston nimessä.
<ORI>	<ORI> osa palautetiedoston nimessä.
<YYMMDD>	<YYYYMMDD> osa palautetiedoston nimessä, josta vuosisata poistettu.
<FDSEQ>	<FDSEQ> osa palautetiedoston nimessä.

Esimerkki:

Palautetiedoston nimi:

FD\_TR\_12340012345678901269\_01\_20170407\_0136.ZIP

<BizMsgldr>: 12340012345678901269\_01201704070136

(33 merkkiä)



#### 4.5.3 Palautetiedostojen MsgRptldr

MsgRptldr yksilöi kaupparaporttitiedoston, jossa kaupparaportti vastaanotettiin.

Käytetään seuraavaa kaupparaporttitiedoston nimessä johdettua tunnista:

<SEIC>\_<ORI><YYMMDD><RFSEQ>

<SEIC>	<SEIC> osa kaupparaporttitiedoston nimessä.
<ORI>	<ORI> osa kaupparaporttitiedoston nimessä.
<YYMMDD>	<YYYYMMDD> osa kaupparaporttitiedoston nimessä, josta vuosisata poistettu.
<RFSEQ>	<RFSEQ> osa kaupparaporttitiedoston nimessä.

Esimerkki:

Kaupparaporttitiedoston nimi:

TR\_12340012345678901269\_01\_20170407\_0136.ZIP

<MsgRptldr>: 12340012345678901269\_011704070136  
(33 merkkiä)



19.5.2021

Julkinen

## 5 Viitteet

1. <https://www.esma.europa.eu/policy-rules/mifid-ii-and-mifir/mifir-reporting-instructions>
2. [https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1452\\_guidelines\\_mifid\\_ii\\_transaction\\_reporting.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/2016-1452_guidelines_mifid_ii_transaction_reporting.pdf)
3. [https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/validation\\_rules.xlsx](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/validation_rules.xlsx)