

Nyhedsbrev

Finanstilsynet orienterede på mødet den 2. september 2008 bl.a. omkring brugen af AII koder og den entydige identificering af handelssystemet i forbindelse med systematisk internalisering (SI).

Vedrørende brugen af AII koder er der nedenfor beskrevet nogle væsentlige forhold omkring indberetningerne.

Det samme gør sig gældende for systematisk internalisering. Det indberetningskrav, der blev meldt ud den 2. september 2008, er nu ændret.

AII koder:

AII koder skal bruges, hvis der handles på et AII marked.

Finanstilsynet skal gøre opmærksom på, at CESRs MiFID database indeholder 11 AII markeder.

TRS systemet tillader kun indberetning fra otte af de nævnte AII markeder. De otte AII markeder er anført i tabellen nedenfor. De tre markeder, som TRS systemet ikke kan modtage indberetninger fra, er råvaremarkeder.

AII markedsplads	Land	MIC
LIFFE BRUSSELS	Belgium	XBRD
EURONEXT PARIS MATIF	France	XMAT
EURONEXT PARIS MONEP	France	XMON
EUREX DEUTSCHLAND	Germany	XEUR
ATHENS EXCHANGE DERIVATIVES MARKET	Greece	XADE
EURONEXT EQF – EQUITIES AND INDICES DERIVATIVES	Netherlands	XEUE
NYSE EURONEXT – MERCADO DE FUTUROS E OPCOES	Portugal	MFOX
THE LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES AND OPTIONS EXCHANGE (LIFFE)	United Kingdom	XLIF

For en mere udførlig gennemgang af AII koder henvises til AII markedspladserne. Der skal desuden gøres opmærksom på, at visse dataleverandører allerede nu kan levere "product exchange codes".

TRS har siden den 3. november 2008 været i stand til at modtage indberetning af transaktioner med AII koder. Som tidligere nævnt er den seneste frist for at påbegynde indberetning af AII transaktioner den 1. april 2009.

Systematisk internalisering (SI):

Til brug for identificering af det handelssystem, hvor transaktionen er udført, skal dette anføres i transaktionsindberetningen ved handelssystemets entydige harmoniserede identifikationskode.

Hvis et selskab foretager systematisk internalisering er den entydige harmoniserede identifikationskode selskabets BIC kode.

Det indebærer, at en værdipapirhandler, der foretager systematisk internalisering, indberetter handlen udfyldt med sin BIC kode i feltet "Venue CodeType". Se nedenstående eksempel.

```
<Venue CodeType="B">BBBBDK2XXX</Venue>
```

Ændringen i indberetningskravet sker alene for modparten. Det er selvsagt kun i det tilfælde, hvor modparten er en indberetningspligtig værdipapirhandler, at det er aktuelt. Den indberetningspligtige værdipapirhandler skal indberette transaktionen ved at angive XOFF i feltet "Venue CodeType". Se nedenstående eksempel.

```
<Venue CodeType="O">XOFF</Venue>
```

TRS har siden den 3. november 2008 været i stand til at modtage indberetning af transaktioner, hvor felt 21 er udfyldt med en BIC kode. Som tidligere nævnt er den seneste frist for, at SI handler påføres BIC kode den 1. april 2009.