

Rapportering av internaliserad avveckling
-
Beskrivning av elektronisk rapportering
Version 1.0.4 (11.12.2019)

11.12.2019

ÄNDRINGSHISTORIA

Version	Datum	Beskrivning av ändringen
1.0.0	3.5.2019	Första versionen
1.0.1	13.5.2019	Korrigerat version
1.0.2	16.8.2019	Korrigerat version
1.0.3	19.11.2019	Med tillägg av specifikationen för nullrapportering (Exempel 2, ingenting att rapportera)
1.0.4	11.12.2019	Ytterligare information om nullrapportering (Module Code, Exempel 2)

INNEHÅLLSFÖRTECKNING

1 Inledning	4
2 Uppgifter som ska rapporteras regelbundet	4
3 Leveransfil	5
3.1 Leveransfilens struktur	5
3.2 Omslagsrapport	6
3.2.1 Omslagsrapportens struktur	6
3.2.2 Specifikationer av XML-namnrymder	7
3.2.3 Specifikationer av metadata	7
3.2.4 Specifikationer av grundkoder	8
3.3 Rapporten om internaliserad avveckling	9
3.3.1 Rapportens struktur	9
3.3.2 Schemafilerna för rapportering	9
4 Kryptering och packning	10
5 Namngivning av filer	10
6 Inlämning av uppgifter som rapporteras till Finansinspektionen	11
7 Närmare upplysningar	11
BILAGA 1. Frågor och svar (Q&A)	12

1 Inledning

Enligt artikel 9 i förordningen om värdepapperscentraler ([Förordning \(EU\) nr 909/2014 \(CSDR\)](#)) ska företag som internaliserar avveckling rapportera om transaktioner som de avvecklar internt. Rapporterna om internaliserad avveckling bör varje kvartal ge detaljerad information till behöriga myndigheterna om den aggregerade volymen och det aggregerade värdet av avvecklingsinstruktioner som företag som internaliserar avveckling har verkställt utanför avvecklingssystem för värdepapper. De behöriga myndigheterna ska utan dröjsmål överföra de erhållna uppgifterna till den Europeiska tillsynsmyndigheten, Esma och informera Esma om alla risker med anledning av denna avvecklingsverksamhet. Detaljerad reglering av internaliserad avveckling finns i följande:

- [CSDR](#)
- [Kommissionens delegerade förordning \(EU\) 2017/391](#)
- [Kommissionens genomförandeförordning \(EU\) 2017/393](#)
- [Esmas riktlinjer för rapportering om internaliserad avveckling enligt artikel 9 i CSD-förordningen](#)

I beskrivningen presenteras de särskilda nationella krav som inte framgår av Esmas tekniska anvisningar. Beskrivningen av den elektroniska rapporteringen enligt detaljerad reglering av internaliserad avveckling tillämpas på genereringen och leveransen av information för rapporteringen till Finansinspektionen från och med Q3 2019.

Uppgifterna ska rapporteras i XML-format (Extensible Markup Language) enligt Esmas krav. Rapporterna som ska lämnas in till Finansinspektionen sammanställas av rapportören själv utifrån den givna beskrivningen (inkluderar skapande av rapportfiler, validering av uppgifter samt kryptering och packning av leveransfiler).

2 Uppgifter som ska rapporteras regelbundet

Företag som internaliserar avveckling ska rapportera sina relevanta uppgifter till behöriga myndigheter inom 10 arbetsdagar efter utgången av varje kvartal per kalenderår. De behöriga myndigheterna ska överföra de erhållna uppgifterna till den Europeiska tillsynsmyndigheten, Esma.

Företag kan lämna in den första rapporten till Finansinspektionen först efter utgången av det tredje kvartalet (Q3 2019) dvs i början av Oktober 2019. Uppgifter för Q2 kan rapporteras så fort som rapportören har försäkrat sig om att rapporteringen fungerar både vad gäller form och rapportinnehåll. Företag som internaliserar en avveckling ska rapportera till Finansinspektionen på det sätt som avses i artikel 9.1 i förordningen om värdepapperscentraler enligt följande:

- en rapport för Finlands del (även verksamheten i dess filialer i samma land);
- en separat rapport för verksamheten för dess filialer per medlemsstat;
- en rapport för verksamheten för dess filialer i tredjeländer.

11.12.2019

Den flerdimensionella rapporteringen av internaliserad avveckling – så kallad STT, innehåller bl.a. följande delområden (statistik över misslyckade internaliserade avvecklingar förs skilt indelade på motsvarande sätt).

- typ av instrument;
- typ av avveckling (t.ex. köp eller försäljning, garanti, repor osv.);
- typ av kund (professionell, icke-professionell);
- Indelat enligt värdepapperscentraler som behandlar olika instrument.

Ytterligare information liksom omfattning av de uppgifter som ska rapporteras av företag som internaliserar avveckling, enheter som ansvarar för rapportering till behöriga myndigheter, datarapporteringsparametrar och process för inlämning av internaliserade avvecklingsrapporter beskrivs närmare i [Esmas riktlinjer för rapportering om internaliserad avveckling enligt artikel 9 i CSD-förordningen](#).

Finansinspektionen kräver både rapportfiler enligt Esmas beskrivningar och en separat XML-omslagsrapport som beskrivs närmare i kapitel 3 om den här beskrivningen (leveransfil).

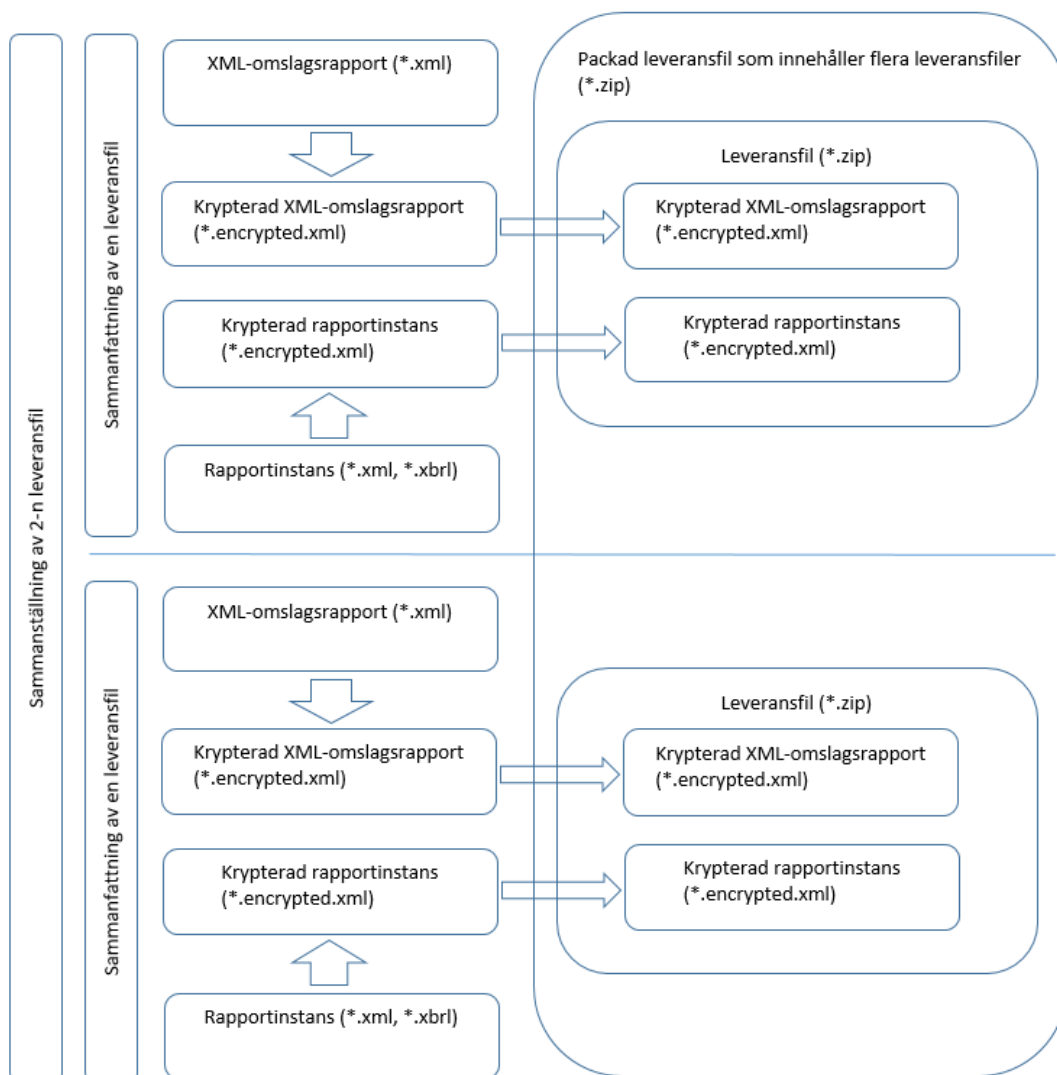
Förändringar som påverkar rapporteringsskyldigheten ska anmälas till Finansinspektionen separat.

3 Leveransfil

3.1 Leveransfilens struktur

Filen som inlämnas till Finansinspektionen (leveransfilen) ska vara packad i en zip-fil och innehålla en krypterad XML-omslagsrapport och den packade och krypterade rapport i XML-format som innehåller egentliga data. Till leveransen kan fogas flera separata leveransfiler i .zip-format, eller så kan leveransfiler i .zip-format packas i ytterligare en .zip-fil som inlämnas till Finansinspektionen enligt figur 1.

11.12.2019



Figur 1: Uppbyggnad av en leveransfil

3.2 Omslagsrapport

3.2.1 Omslagsrapportens struktur

Finansinspektionen kräver både rapportfiler enligt ESMA:s beskrivningar och en separat XML-omslagsrapport.

Finansinspektionens instruktioner om en omslagsrapport i XML-format bygger delvis på en specifikation i CEN-projektet för beredning av standardiserad rapportering (http://cen.eurofiling.info/wp-content/uploads/data/CWA_XBRL_WI002-E.pdf). Schemat för omslagsrapporten kan laddas ner från Finansinspektionens webbplats: [schemafilen](#).

Följande förkortningar används i CEN-projektet:

11.12.2019

- CEN: **Comité Européen de Normalisation / European Committee for Standardization**
- CWA: **CEN Workshop Agreement**

(källa: <http://cen.eurofiling.info/>)

Omslagsrapporten består av följande delar:

- Specifikationer av XML-namnrymder
- Specifikationer av metadata
- Specifikationer av grundkoder

3.2.2 Specifikationer av XML-namnrymder

I början av omslagsfilen fastställs specifikationer av schemafilerna och övriga namnrymder, se avsnitt 3.2.1 Omslagsrapportens struktur.

Varje XML-fil inleds alltid med specifikationer av XML-namnrymder. Begreppen i de olika XML-filerna skiljs åt med hjälp av namnrymder.

Exempel 1.

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<FivaStandardHeader
xmlns="http://www.finanssivalvonta.fi/Raportointi/xbrl/Documents/FivaStandardHeader"
xmlns:bh="http://www.eurofiling.info/eu/fr/esrs/Header/BasicHeader"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">

    <!-- innehåll -->
</FivaStandardHeader>
```

3.2.3 Specifikationer av metadata

Följande metadata ska inkluderas i omslagsrapporten:

- Rapporteringstidpunkt (InstanceCreationDateTime; yyyy-mm-ddThh:mm:ss; t.ex. 2015-01-07T16:22:00+02:00, GMT + 02:00); tidpunkten då rapportören har upprättat leveransfilen
- Tidpunkt för inrapporterade uppgifter (ReportingPeriod; yyyy-mm-dd; t.ex. 2014-12-31)
- Typen av rapportörens ID-kod (ReportingEntityType; TK-tunnus¹, Y-tunnus, LEI, MFI; varchar(9))
- Rapportörens ID-kod (ReportingEntity; TK-tunnus, Y-tunnus², LEI, MFI; varchar(50))
- Uppgiftslämnarkategori³ (TypeOfReportingInstitution; nnn; varchar(9))
- Namn på rapporteringsprogrammet⁴ (ReportingApplicationName; varchar(80))

¹ En sjuställig ID-kod som genererats av Finansinspektionen.

² Nationellt FO-nummer utan bindestreck med åtta tecken.

³ [Uppgiftslämnarna](#)

⁴ Namn på rapportörens eget system.

11.12.2019

- Version av rapporteringsprogrammet⁵ (ReportingApplicationVersion; varchar(40))
- Förnamn på rapportörens kontaktperson (ContactPersonFirstName; varchar(50))
- Efternamn på rapportörens kontaktperson (ContactPersonLastName); varchar(50)
- E-postadress för rapportörens kontaktperson (ContactPersonEmail; varchar(100))
- Telefonnummer för rapportörens kontaktperson (ContactPersonTelephone; varchar(50))
- Kommentar ((Comment); valfri)
- Testleveranskod (TestFlag; produktionsleverans = false; testleverans = true)
- Antal rapporteringssfiler (NumberOfFiles; 0 = ingenting att rapportera, optional)
- Module Code (ModuleCode; STT, används i samband med NumberOfFiles fält, optional)
-

Exempel 2:

```
<InstanceCreationDateTime>2015-01-07T16:22:00+02:00</InstanceCreationDateTime>
<ReportingPeriod>2014-12-31</ReportingPeriod>
<ReportingEntityType>TK-tunnus</ReportingEntityType>
<ReportingEntity>9999999</ReportingEntity>
<TypeOfReportingInstitution>354</TypeOfReportingInstitution>
<ReportingApplicationName>ApplicationX</ReportingApplicationName>
<ReportingApplicationVersion>1.0.0</ReportingApplicationVersion>
<ContactPersonFirstName>Tylle</ContactPersonFirstName>
<ContactPersonLastName>Testaaja</ContactPersonLastName>
<ContactPersonEmail>tylle.testaaja@fiva.fi</ContactPersonEmail>
<ContactPersonTelephone>+358-00 000 0000</ContactPersonTelephone>
<Comment>Revision123</Comment>
<TestFlag>>false</TestFlag>
<NumberOfFiles>0</NumberOfFiles>
<ModuleCode>STT</ModuleCode>
```

3.2.4 Specifikationer av grundkoder

Avsnittet med grundkoder (BasicHeader) innehåller följande uppgifter:

- ReportReferenceID = En fritt formulerad teknisk kod som beskriver innehållet i uppgifterna som inlämnas i leveranspaketet.
- FilePath = Rapportfilens namn (inkl. filändelsen) i leveranspaketet.

Exempel 3:

```
<BasicHeader>
  <bh:ReportDataContext>
    <bh:ReportReferenceID>REF_00001</bh:ReportReferenceID>
  </bh:ReportDataContext>
  <bh:File>
    <bh:FilePath>FILE 9999999 20181231.encrypted.xml</bh:FilePath>
  </bh:File>
</BasicHeader>
```

⁵ Version av rapportörens eget system.

3.3 Rapporten om internaliserad avveckling

3.3.1 Rapportens struktur

Rapportören ska säkerställa att filen uppfyller formkraven på XML-schemafilerna samt de innehållsmässiga integritetskraven i ESMA:s tekniska rapporteringsanvisningar.

- GUIDELINES ON INTERNALISED SETTLEMENT REPORTING UNDER ARTICLE 9 OF CSDR [ESMA70-151-1258](#).
- ESMA validationrules TECHNICAL GUIDANCE FOR SETTLEMENT INTERNALISERS – REPORT VALIDATION RULES (CSDR ARTICLE 9) [ESMA65-8-6251](#).

Närmare beskrivningar enligt informationsinnehåll för rapporteringen finns i www.iso20022.org sidan [Message Definition Report - Part 2](#).

3.3.2 Schemafilerna för rapportering

Strukturen för rapportens innehåll beskrivs i filerna BusinessDataHeaderV01.xsd, BusinessApplicationHeaderV01.xsd och FinancialInstrumentReportingStatusAdviceV01.xsd. Specifikationerna av dataelement beskrivs i filerna med typspecifikationer SettlementInternaliserReportV01.xsd. Schemafilerna kan finnas i filen [related XML files](#).

Exempel 4:

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<BizData
  xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01
head.003.001.01.xsd"
  xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01"
  xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">
  <Hdr>
    <AppHdr
      xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01
head.001.001.01.xsd"
      xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01"
      xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">
      <Fr><OrgId><Id><OrgId><Othr><Id>FI</Id></Othr></OrgId></Id></OrgId></Fr>
      <To><OrgId><Id><OrgId><Othr><Id>CSDRS9</Id></Othr></OrgId></Id></OrgId></To>
<!--Tähän asti vakiomuotoista-->
      <BizMsgIdr>FI-LEI_tms_tunniste-2019-Q2_001</BizMsgIdr><!--Max 35-->
      <MsgDefIdr>auth.072.001.01</MsgDefIdr>
      <CreDt>2019-06-04T07:44:18Z</CreDt>
    </AppHdr>
  </Hdr>
  <Pyld>
  ...
```

4 Kryptering och packning

Såväl omslagsrapporten som den zip-packade rapporten ska krypteras innan de packas till en leveransfil (*.zip). För krypteringen ska användas programmet BOF-CryptNxt, som kan laddas ner via Jakelu Distributionstjänst. Slutdelen av de krypterade filerna ska vara ".encrypted.xml".

5 Namngivning av filer

Namnet på rapportfilerna borde ha formen:

- omslagsrapport
 - header_<modul>_<rapportörkategori>_<rapportörsID>_<period>.xml
- krypterad omslagsrapport
 - header_<modul>_< rapportörkategori >_<rapportörsId>_<period>.encrypted.xml
- STT-rapport
 - <modul>_< rapportörkategori >_<rapportörsID>_<period>.xml
- krypterad STT-rapport
 - <modul>_< rapportörkategori >_<rapportörsID>_<period>.encrypted.xml
- leveransfil
 - container_<modul>_<rapportörsID>_<period>.zip
- en leveransfil bestående av flera leveransfiler
 - <STT>_<id>.zip

Filnamnets delar har följande betydelse:

- header: ID-kod för omslagsrapporten: *header*
- <modul>: STT-rapport: *STT*
- <rapportörkategori>: rapportörkategori
- <rapportörsID> ID-kod (LEI/TK-tunnus/Y-tunnus)
- <period>: tidpunkt för rapporterade uppgifter (yyyymmdd)
- container: ID-kod för leveransfilen: *container*
- STT: kod för fil som innehåller flera leveransfiler: *STT*
- <id>: valfri kod, t.ex. löpande nummer

Obligatoriska begränsningar:

Filslut:

- omslagsrapporten: ".xml"
- rapporten: ".xml"
- leveransfilen: ".zip"

Den krypterade omslags-/ XML-rapportens namn:

- "[ursprungligt namn].encrypted.xml"
- maximilängd 150 tecken
- namnet ska vara unikt i försändelsen

11.12.2019

6 Inlämning av uppgifter som rapporteras till Finansinspektionen

Leveransfilen (zip) skickas som bifogad fil per e-post enligt standard rapporteringsprotokoll.

7 Närmare upplysningar

Närmare upplysningar fås från e-postadressen **STTHelpdesk[at]fiva.fi**.

BILAGA 1. Frågor och svar (Q&A)

Fråga 1. Should issuer CSD country code be filled in the reports?

Potential confusion caused by the following references:

1. Final Report, Guidelines:

19. Competent authorities should ensure that settlement internalisers include the first two characters of the ISINs in the reports.

In accordance with Article 2(1) of the Commission Delegated Regulation (EU) 2017/391, the LEI of the Issuer CSD should also be filled in by the settlement internaliser; potentially, several Issuer CSDs could be included in relation to securities identified by the same two characters of the ISINs. **The Issuer CSD country code should not be filled in by the settlement internaliser, as it will be determined by the ESMA CSDR IT system.**

2. Technical Guidance:

'Issuer CSD' section: the following comment has been added in the CSDR9 derived message definition to further clarify the usage of this section

- Defines dataset relating to the combination between the first two characters of the ISIN and the LEI of the Issuer CSD (when provided). Each combination of the first two characters of the ISIN and the LEI should be unique.

'Issuer CSD' section - 'LEI' element: the following comment has been added in the CSDR9 derived message definition to further clarify the usage of this element

- The LEI code is used to identify the Issuer CSD. Although optional, if it is known, it should be provided.

'Issuer CSD' section - 'First Two Characters Instrument Identification' element: the following comment has been added in the CSDR9 derived message definition to further clarify the usage of this element

- If the instrument identifier is a valid ISIN or follows the ISIN format, the first two characters of the instrument identifier should be used. For financial instruments without an ISIN or ISIN formatted identifier, the 2 character code 'IC' should be used.

'Issuer CSD' section - 'Country' element: the following comment has been added in the CSDR9 derived message definition to further clarify the usage of this element

- **The country code is used for the identification of the Issuer CSD and must be provided only if the LEI of the Issuer CSD is also provided.**

Svar 1.

No. The Issuer CSD country code should not be filled in the reports, it will be generated automatically by the ESMA IT system based on the LEI of the Issuer CSD. This is in order to avoid any discrepancies between the two.

11.12.2019

Fråga 2.

Where to locate the EXCEPTION LIST for the CHARACTERS PAIRINGS from the first two characters of the ISIN code not in the ISO 3166 standard list? Looking at the universe of ISINs we can identify two character combinations that are not fulfilling the rule (XS and EU).

Reference: "Technical Guidance for Settlement Internalisers – Report Validation Rules" page 48 bullet 6.3 (validation rules):

The first two characters of the ISIN code <FrstTwoCharsInstrmld> of the financial instruments must be provided. The characters pairing must map to a valid ISO-3166-1 2- characters country code. This rule is not applied for character pairings that are explicitly set as exceptions by the ESMA IT Administrator.

Svar 2.

The reporting entity does not need to do the mapping. They just need to use the "XS" code. The ESMA IT system does the mapping in order to give access to the competent authorities (in the case of XS, both to the BE and LU authorities). it will be automatically generated by the ESMA IT system based on the LEI of the issuer CSD. This is in order to avoid any discrepancies between the two.

The system is by default configured with the following pairings (a relevant script is provided along with the release material):

- "EU"- "DE" (i.e. EU ISINs are accessible by Germany Competent Authority (CA) users)
- "XS"- "LU" (i.e. XS ISINs are accessible by Luxemburg CA users)
- "XS"- "BE" (i.e. EU ISINs are accessible by Belgium CA users)
- "CS"- "CZ" (i.e. CS ISINs are accessibly by Czech CA users)
- "IC"-all EU countries (i.e. one record per EU country, so that all EU Member States to obtain access to XY financial instruments)

With respect to the 'TS' code, this code relates to the 'Branch Identification' code and not to the 'First Two Characters of the ISIN', and hence it is not configured through the 'Manage ISIN/Country code pairings' page. And by default users can submit reports of branches operating outside the EU with the 'Branch Identification' code as 'TS'; as per the specifications all reports that contain this code in the 'Branch Identification' element, are accessible by all CAs.