

Notat

Strukturen i XML-indberetningsfilen – repoindberetningen

Indledning

I dette notat beskrives strukturen i XML-filen for repoindberetningen, som skal sendes til Nationalbankens elektroniske indberetningssystem, STINA. Vejledningen er møntet på de medarbejdere, der skal udvikle XML-filen.

Det øvrige materiale, som er nødvendigt for at kunne danne en korrekt XML-fil, er omfattet af indberetningsvejledningen og de tilhørende bilag.

Opbygningen af repoindberetningens XML-struktur følger XML-strukturen i KDE2-indberetningen meget tæt.

Strukturen af XML-indberetningsfiler til repoindberetningen

XML-indberetningsfilen bygges op af fire niveauer, der ved hjælp af et element i XML-filen beskriver statistik, holdertype, om værdipapiret har en ISIN-kode eller ej samt en række papir-karakteristika.

Som konvention er det valgt, at al information bæres i form af værdier til attributter til elementerne, der er tomme, dvs. ikke har selvstændige værdier. Hvor der ikke er værdier at angive for en ikke-obligatorisk attribut, skal attributten i sin helhed (dvs. attributnavn samt angivelse af værdi) helt udelades i XML-filen. Det er dermed i en sådan situation ikke tilladt at anføre attributnavnet med tilknyttet tom værdi (f.eks. attnavn="") i XML-filen.

I det følgende gennemgås de fire niveauer i XML-indberetningsfilen.

1. niveau:

Det første (og yderste) niveau beskriver statistikken. Elementet har navnet "REPO" og der er to attributter med navnene "version" og "language".

2. niveau

Det andet niveau består af et masterdata-element samt i alt 3 elementer, der repræsenterer hver sin modpartstype.

I enhver XML-indberetningsfil skal der være netop et masterdata-element, hvori generelle oplysninger om indberetter (stamdata) angives.

Masterdata-elementet har følgende attributter, der bærer flg. information:

Attributliste for Masterdata-elementet

Attribut-navn	Attribut-indhold
loebenr	Løbenummer for indberetning
refperio	Referenceperiode
idno	Indberetters CVR-nr.
firmanavn	Indberettes navn
gadenavn	Indberetters gade/vej og nr.
boks	Indberetters evt. postboks
postnr	Indberetters addresses postnummer
by	Indberetters addresses by
tlf	Indberetters telefonnummer (depotbankens hovednr.)

I Masterdata-elementet skal anføres ét element af typen kontaktpersoner - et tomt element uden attributter. I elementet kontaktpersoner skal der være fra et og op til ti elementer af typen person, der har følgende attributter:

Attributliste for person-elementer

Attribut-navn	Attribut-indhold
fuldtnavn	Kontaktpersons fulde navn
email	Kontaktpersons email
tlf	Kontaktpersons telefonnummer

De 3 modpartstyper repræsenteres af 3 elementer, der alle er tomme og heller ikke har tilknyttede attributter. Modpartstyperne og deres elementer er:

Elementnavn	Modpartstype
dkcvr	Indenlandsk virksomhed
dksektor	Valutaindlænding uden CVR-nr.
valutaudl	Valutaudlænding

I en XML-indberetningsfil skal der forefindes netop et element for de holdertyper, der indberettes beholdningsoplysninger for. Findes der holdertyper, der ikke haves beholdningsoplysninger for, skal det tilhørende element ikke optræde i XML-indberetningsfilen.

Eksempel 1:

De to yderste niveauer i en XML-indberetningsfil danner følgende træstruktur (idet attributter er udeladt af hensyn til overskuelighed):

```
<REPO>
  <masterdata ...>
    <kontaktpersoner>
      <person .../>
    </kontaktpersoner>
  </masterdata>
  <dkcvr>...</dkcvr>
  <dksektor>...</dksektor>
  <valutaudl>...</valutaudl>
</REPO>
```

3. niveau

I tredje niveau foretages en opdeling mellem repoforretninger baseret på beholdninger af papirer med og uden ISIN-kode. Det tredje niveau har to elementer, der begge er tomme og uden tilknyttede attributter. Første element har navnet ”medisinkode” og andet element ”udenisinkode”. For papirer, der indberettes uden ISIN-kode, angives en intern kode.

Disse elementer skal optræde i XML-indberetningsfiler netop hvis der skal indberettes oplysninger om repoforretninger baseret på beholdning af papirer med henholdsvis uden ISIN-kode.

Under disse elementer angives – som elementnavnene antyder – oplysninger om beholdninger af værdipapirer med henholdsvis uden kode.

Eksempel 2:

Det andet og tredje niveau i en XML-indberetningsfil danner følgende træstruktur (idet attributter er udeladt af hensyn til overskuelighed):

```
<dkcvr>
  <medisinkode>...</medisinkode>
  <udenisinkode>...</udenisinkode>
</dkcvr>
<dksektor>
  <medisinkode>...</medisinkode>
  <udenisinkode>...</udenisinkode>
</dksektor>
...
```

(Eksempel slut)

4. niveau

I XML-indberetningsfilens fjerde (og inderste) niveau angives oplysninger om repoforretninger baseret på beholdninger af værdipapirer. Dette gøres ved angivelse af en række attributter til et eller flere elementer med navnet ”papir”, idet hvert papir-element repræsenterer den i en repoforretning med en given modpart udvekslede beholdning af det pågældende værdipapir.

Der skal i XML-indberetningsfilen angives papir-elementer for enhver beholdning af ethvert papir, der er indgået med enhver modpart af enhver modpartstype som led i en repoforretning (jf. også indberetningsvejledningen).

For hvert papir angives desuden forretningstypen (der skelnes mellem repohv. pantsætningsforretninger mv., jf. indberetningsvejledningen).

Den konkrete beskrivelse af papiret via attributter afhænger af, om der indberettes med eller uden ISIN-kode. I tilfælde af indberetning med ISIN-kode kan Nationalbanken vha. denne finde en række oplysninger om værdipapiret i vp.FACT. Indberettes papiret med en intern kode, er det nødvendigt at angive de tilsvarende oplysninger i form af værdier i attributter.

Attributterne i de to situationer er som følger:

Med ISIN-kode: Attributliste

Attribut-navn	Attribut-indhold
modpartskode*	Identifikation af modpart*
depotstedmodpart	Modparts depotsted
antalstk	Antal styk (beholdning af papir)
nomvaerdi	Nominel værdi
markedsvaerdi	Markedsværdi
notval	Noteringsvaluta
handval	Handelsvaluta
isin	ISIN-kode
papirnavn	Papirnavn
boersid	Børs-id
forrtype	Forretningstype
valdatospot**	Valørdato for spotben
valdatotermin**	Valørdato for terminsben

ordrenrspot	Ordrenummer for spothandlen
ordrenrtermin	Ordrenummer for terminshandlen
depotstedindb	Indberetters depotsted

*) Se nedenfor vedr. angivelse af modpartsidentifikation. **) Angives kun for repoforretninger.

Uden ISIN-kode: Attributliste

Attribut-navn	Attribut-indhold
modpartskode*	Identifikation af modpart*
depotstedmodpart	Modparts depotsted
antalstk	Antal styk (beholdning af papir)
nomvaerdi	Nominel værdi
markedsvaerdi	Markedsværdi
instrkode	Instrumentkode
udstsekt	Udsteders sektor
udstland	Udsteders hjemland
udststed	Udstedelsessted
notval	Noteringsvaluta
handval	Handelsvaluta
internkode	Intern kode
papirnavn	Papirnavn
forrtype	Forretningstype
valdatospot**	Valørdato for spotben
valdatotermin**	Valørdato for terminsben
ordrenrspot	Ordrenummer for spothandlen
ordrenrtermin	Ordrenummer for terminshandlen
depotstedindb	Indberetters depotsted

*) Se nedenfor vedr. angivelse af modpartsidentifikation. **) Angives kun for repoforretninger.

For hver modpartstype er der i papir-elementer angivet selvstændig(e) attribut(ter) til beskrivelse af identifikation af de enkelte modparter af den pågældende modpartstype. Eksempelvis er der for modpartstypen "Indenlandsk virksomhed" angivet en attribut, "cvrn", i papir-elementer, der beskriver beholdninger af papirer, hvor modparten i forretningen er indenlandske virksomheder.

I nedenstående tabel er angivet navne og indhold for disse modpartsidentifikationsattributter i papir-elementer, der beskriver de enkelte modpartstypers værdipapirbeholdninger :

Modparttype	Navn på attribut(ter) i papir-element	Indhold i attribut
Indenlandsk virksomhed	cvrn	Cvr-nr.
Valutaindlænding uden CVR-nr.	sektorkode	Sektorkode
Valutaudlænding	landekode, sektorkode	ISO-landekode hhv. sektorkode.

Eksempel 3:

Andet, tredje og fjerde niveau i en XML-indberetningsfil danner følgende træstruktur (idet attributter er udeladt af hensyn til overskuelighed):

```

<dkcvr>
  <medisinkode>
    <papir ... />
    <papir ... />
    ...
  </medisinkode>
  <udenisinkode>
    <papir ... />
    <papir ... />
    ...
  </udenisinkode>
</dkcvr>
...

```

(Eksempel slut)