



European Securities and
Markets Authority

Riktlinjer

Rapportering enligt artiklar 4 och 12 förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering



Innehållsförteckning

1	Hänvisningar till lagstiftning, förkortningar och definitioner	6
2	Tillämpningsområde	7
3	Syfte.....	8
4	Allmänna principer.....	9
4.1	Startdatum för rapportering	9
4.2	Fastställande av antalet transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av rapporteringsskyldigheten.....	9
4.2.1	Marknadstransaktioner som inte omfattas av definitionen av transaktion för värdepappersfinansiering	9
4.2.2	Aspekter kring alla typer av transaktioner för värdepappersfinansiering	10
4.2.3	Aspekter kring repor	11
4.2.4	Aspekter kring köp- och återförsäljningstransaktioner respektive sälj- och återköpstransaktioner.....	12
4.2.5	Aspekter kring utlåning och inlåning av värdepapper.....	12
4.2.6	Aspekter kring transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror	13
4.2.7	Aspekter kring marginalutlåning	14
4.3	Rapportering av transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart	15
4.4	Ansvarsfördelning enligt artikel 4.3 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.....	16
4.4.1	Det allmänna fallet	16
4.4.2	Finansiella motparter i tredje länder (TC-FC).....	16
4.4.3	Fonder.....	17
4.5	Frivillig delegering av rapportering.....	17
4.6	Tillämpning av rapporteringsskyldighet enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering på transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna av filialer	17
4.6.1	Tillämpning av rapporteringsskyldighet enligt förordningen när det gäller transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna av enheter utanför EU med filialer i EU.....	17
4.6.2	Fastställande av rapporteringsskyldighet för transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna mellan filialer	17
4.7	Rapportering av en icke-finansiell motpart.....	19

4.8	Åtgärdstyper.....	19
4.8.1	Tillämpliga åtgärdstyper	19
4.8.2	Fullständig eller delvis rapportering av ändringar i transaktioner för värdepappersfinansiering	20
4.8.3	Ordningsföljden av åtgärdstyper för olika typer av meddelanden	20
4.9	Rapportering i god tid av ingående, modifiering och avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering.....	24
4.9.1	Ingående av en transaktion för värdepappersfinansiering	24
4.9.2	Ändring och korrigerig av en transaktion för värdepappersfinansiering.....	25
4.9.3	Uppdateringar av säkerhet	25
4.9.4	Uppdateringar av värdering, marginalsäkerhet och återanvändning	26
4.9.5	Avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering.....	27
4.9.6	Översikt över rapporteringstidpunkter per rapport- och åtgärdstyp	28
4.10	Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå	28
4.11	Identifiering av en deltagare i en central värdepapperscentral.....	36
4.12	Fastställande av motpartssida.....	37
4.12.1	Det allmänna fallet	37
4.12.2	Transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart.....	37
4.12.3	Rapportering av utlåning/inlåning av värdepapper utan säkerhet	37
4.12.4	Rapportering av motpartssidan vid säkerhet på nettoexponeringsbasis	37
4.13	Fält för pris och värde.....	37
4.13.1	Värderingstidpunkter	37
4.13.2	Beräkningsmetod för värderingar	38
4.14	Rapportering av CFI-koden för ett värdepapper som används som säkerhet	38
4.15	Senareläggning	39
4.16	Generering och uppbyggnad av UTI-koder.....	39
4.17	Identifiering och rapportering av förmånstagare	41
4.18	Identifiering av värdepapper och emittent av värdepapper	41
4.19	Procedur om en av motparterna genomgår en företagshändelse	42
4.20	Rapportering under övergångsperioden	43
5	Tabeller om fält enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering	43
5.1	Uppgifter om motparter	46
	Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITs management company delegates reporting to a third party	47
	Non-cleared SFTs concluded by AIF	47

Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced.....	47
5.1.1 Ej clearade bilaterala transaktioner för värdepappersfinansiering mellan huvudkontor	47
5.1.2 Ej clearade bilaterala transaktioner för värdepappersfinansiering mellan filialer ...	49
5.1.3 Ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering med förmånstagare	51
5.1.4 Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, avvecklad med en depåbank	53
5.1.5 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för en långgivare och trepartsagent.....	54
5.1.6 Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent, avvecklad med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part.....	56
5.1.7 Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent	58
5.1.8 Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part	61
5.1.9 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av ett fondföretag	63
5.1.10 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av ett fondföretag varvid fondföretagets förvaltningsbolag delegerar rapporteringen till en tredje part	65
5.1.11 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av en alternativ investeringsfond.....	66
5.1.12 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering där förvaltning av fondens portfölj har getts i uppdrag.....	68
5.2 Uppgifter om lån och säkerhet.....	70
5.2.1 Rapportering av åtgärdstyper på transaktionsnivå och positionsnivå.....	70
5.3 Uppgifter om lån.....	82
5.3.1 Rapportering av händelsens datum.....	82
5.3.2 Rapportering av clearade respektive ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering	83
5.3.3 Handelsplats	89
5.3.4 Avsnitt för ramavtal	89
5.3.5 Ingåendet och inledandet av transaktionen	92
5.3.6 Löptid för transaktionen för värdepappersfinansiering	94
5.3.7 Möjlighet till avslutande	96

5.3.8	Allmänna och särskilda säkerhetsarrangemang	96
5.3.9	Fasta eller rörliga räntor	99
5.3.10	Kapitalbelopp för repor och köp- och återförsäljningstransaktioner/sälj- och återköpstransaktioner.....	102
5.3.11	Lånesidan vid utlåning av värdepapper	103
5.3.12	Värdepapper	104
5.3.13	Transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror – utlåning av råvaror.....	109
5.3.14	Utlåning och inlåning av värdepapper med kontantrabatt	111
5.3.15	Avgiftsbaserad utlåning eller inlåning av värdepapper: Utlåning eller inlåning av värdepapper med icke-kontant säkerhet, utlåning eller inlåning av värdepapper med kassapool och utlåning eller inlåning av värdepapper utan säkerhet	112
5.3.16	Beloppet av marginallån och marknadsvärdet för korta positioner.....	113
5.4	Uppgifter om säkerhet	116
5.4.1	Rapportering av säkerhet för en utlåning eller inlåning av värdepapper	116
5.4.2	Säkerhet.....	117
5.4.3	Kontantsäkerhet.....	124
5.4.4	Rapportering av nollsäkerhet.....	125
5.4.5	Fälten för värdepapper som säkerhet.....	125
5.4.6	Tilläggsmarginalsäkerhet på transaktionsnivå för ej centralt clearade transaktioner för värdepappersfinansiering	136
5.4.7	Tilläggsmarginalsäkerhet för ej centralt clearade transaktioner för värdepappersfinansiering vid säkerhet på grundval av nettoexponering.....	145
5.4.8	Förutbetalad säkerhet för utlåning eller inlåning av värdepapper.....	186
5.4.9	Portfölj av clearade transaktioner	188
5.5	Uppgifter om marginalsäkerhet	188
5.5.1	Central motpart som står emellan de två motparter som är clearingmedlemmar	189
5.5.2	Central motpart som står emellan de två motparter som inte är clearingmedlemmar	189
5.5.3	Rapportering av uppgifter om marginalsäkerhet.....	189
5.6	Uppgifter om återanvändning, återinvestering av kontanter och finansieringskällor	191
5.6.1	Återanvändning av säkerhet.....	191
5.6.2	Återinvestering av kontantsäkerhet	198
5.6.3	Ingen återanvändning av icke-kontantsäkerhet eller återinvestering av kontanter	205
5.6.4	Finansieringskällor	206
6	Återkoppling om avvísning.....	207



7	Återkoppling om avstämning	209
8	Utebliven återkoppling om säkerhet.....	212
9	Inlämnande av information till myndigheter.....	213
9.1	Tidsfrister för tillhandahållande av tillgång till uppgifter	213
9.2	Operativa arrangemang för tillgång till uppgifter	214



1 Hänvisningar till lagstiftning, förkortningar och definitioner

Hänvisningar till lagstiftning

<i>AIFM-direktivet</i>	Europaparlamentets och rådets direktiv 2011/61/EU av den 8 juni 2011 om förvaltare av alternativa investeringsfonder
<i>Säkerhetsdirektivet</i>	Europaparlamentets och rådets direktiv 2002/47/EG av den 6 juni 2002 om ställande av finansiell säkerhet
<i>Konsumentkreditdirektivet</i>	Europaparlamentets och rådets direktiv 2008/48/EG av den 23 april 2008 om konsumentkreditavtal och om upphävande av rådets direktiv 87/102/EEG
<i>Tekniska genomförandestandarder för rapportering</i>	Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2019/363 av den 13 december 2018 om fastställande av tekniska genomförandestandarder för form och frekvens för rapportering om detaljer om transaktioner för värdepappersfinansiering till transaktionsregister i enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 och om ändring av kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 vad gäller användning av rapporteringskoder vid rapportering av derivatkontrakt
<i>Emir</i>	Förordningen om Europas marknadsinfrastrukturer – Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 av den 4 juli 2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister
<i>MAR</i>	Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 596/2014 av den 16 april 2014 om marknadsmissbruk (marknadsmissbruksförordningen)
<i>Mifir</i>	Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012
<i>Förordningen om penningmarknadsstatistik</i>	Förordning (EU) nr 1333/2014 om penningmarknadsstatistik
<i>Direktivet om hypotekslån</i>	Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/17/EU av den 4 februari 2014 om konsumentkreditavtal som avser bostadsfastighet och om ändring av direktiven 2008/48/EG och 2013/36/EU och förordning (EU) nr 1093/2010



<i>Remit</i>	Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1227/2011 av den 25 oktober 2011 om integritet och öppenhet på grossistmarknaderna för energi
<i>Tekniska tillsynsstandarder för rapportering</i>	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/356 av den 13 december 2018 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 vad gäller tekniska tillsynsstandarder som specificerar de uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som ska rapporteras till transaktionsregister
<i>Tekniska tillsynsstandarder för tillgång till uppgifter</i>	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/357 av den 13 december 2018 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 vad gäller tekniska standarder för tillsyn i fråga om tillgång till uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som är registrerade i transaktionsregister
<i>Tekniska tillsynsstandarder för kontroll av uppgifter</i>	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/358 av den 13 december 2018 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 vad gäller tekniska tillsynsstandarder för transaktionsregisters insamling, kontroll, aggregering, jämförande och offentliggörande av uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering
<i>Förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering</i>	Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 av den 25 november 2015 om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering och om återanvändning samt om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 (även kallad <i>förordningen</i>)
<i>Tekniska tillsynsstandarder för rapportering</i>	Tekniska tillsynsstandarder för rapportering (kommissionens delegerade förordning (EU) nr 2019/356) och tekniska genomförandestandarder för rapportering (kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 2019/363)
<i>Direktivet om fondföretag</i>	Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/65/EG av den 13 juli 2009 om samordning av lagar och andra författningar som avser företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag)

2 Tillämpningsområde

Vem?

1. Dessa riktlinjer gäller för motparter i transaktioner för värdepappersfinansiering enligt definitionen i artikel 3.2 i förordningen om transparens i transaktioner för



värdepappersfinansiering (*förordningen*), för transaktionsregister enligt definitionen i artikel 3.1 i samma förordning och för behöriga myndigheter.

Vad?

2. Dessa riktlinjer tillämpas med avseende på rapporteringsskyldigheten för transaktioner för värdepappersfinansiering enligt artikel 4 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering, transaktionsregisters skyldigheter enligt artikel 5.7 och artikel 12 i samma förordning och startdatum för rapportering enligt artikel 33.2 i samma förordning.

När?

3. Dessa riktlinjer börjar gälla från och med dagen efter deras offentliggörande på Esmas webbplats eller från och med datumet då relevanta bestämmelser för enheter enligt artikel 33.2 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering börjar gälla, beroende på vilken tidpunkt som infaller senast.
4. Motparterna, de rapporteringsansvariga enheterna och de rapportinlämnande enheterna uppmanas att följa dessa riktlinjer från första tillämpningsdagen för den berörda rapporteringskyldigheten enligt artikel 33.2 a i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.

3 Syfte

5. Dessa riktlinjer baseras på artikel 16.1 i Esmaförordningen. Syftet med dessa riktlinjer är att förtydliga ett flertal av bestämmelserna i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering och att ge praktisk vägledning om hur flera av dessa bestämmelser bör tillämpas. Dessa riktlinjer bidrar till kostnadsbesparingar i hela rapporteringskedjan – för rapporterande motparter, transaktionsregister som inför förfaranden för kontroll av fullständigheten och korrektheten av uppgifter samt för de myndigheter som använder uppgifterna för övervakning av risker för finansiell stabilitet i enlighet med artikel 12.2 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering. Riktlinjerna klargör följande aspekter:
 - a. Startdatum för rapportering om det infaller på en dag som inte är en arbetsdag.
 - b. Antalet transaktioner för värdepappersfinansiering som bör rapporteras.
 - c. Hur datafälten för rapportering av de olika typerna av transaktioner för värdepappersfinansiering bör fyllas i.
 - d. Metoden för sammanlänkning av säkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering till lånetransaktioner för värdepappersfinansiering.
 - e. Hur datafälten för rapportering av uppgifter om marginalsäkerhet bör fyllas i.
 - f. Hur rapporteringsfält för uppgifter om återanvändning, återinvestering och finansieringskällor bör fyllas i.

- g. Transaktionsregisters tillhandahållande av återkoppling och påföljande hantering av återkopplingen hos motparter, nämligen vid i) avvisande av rapporterade uppgifter och ii) avstämningsfel.
- h. Myndigheters tillgång till uppgifter i transaktionsregister.

4 Allmänna principer

4.1 Startdatum för rapportering

- 6. Rapporteringsskyldigheten enligt artikel 4.1 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering börjar gälla från den tillämpningsdag som avses i artikel 33.2 a i i förordningen. Rapporteringsskyldighetens första etapp börjar gälla den 11 april 2020, som infaller på en lördag. Enligt artikel 4.1 i förordningen bör motparter fullgöra sin rapporteringsskyldighet senast den första arbetsdagen efter det att transaktionen ingåtts, ändrats eller avslutats.
- 7. De enheter som avses i artikel 33.2 a i i förordningen och som är etablerade i EU-medlemsstater där den 13 april inte är en helgdag (utan däremot är en arbetsdag) bör från den 13 april 2020 rapportera transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna den 11 april 2020 eller senare.
- 8. De enheter som avses i artikel 33.2 a i i förordningen och som är etablerade i EU-medlemsstater där den 13 april är en helgdag (dvs. inte är en arbetsdag) bör från den 14 april 2020 rapportera transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna den 11 april 2020 eller senare.
- 9. Samma princip bör följas för att fastställa övriga tillämpningsdatum för rapporteringsskyldigheten.

4.2 Fastställande av antalet transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av rapporteringsskyldigheten

- 10. Enligt artikel 1.1 i de tekniska genomförandestandarderna för rapportering bör motparter lämna in sina rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering i ett gemensamt elektroniskt maskinläsbart format och med hjälp av en gemensam XML-mall i enlighet med ISO 20022-metoden. För att underlätta detta inkluderar dessa riktlinjer den XSD-komponent som tillämpas på de olika användningsfallen.

4.2.1 Marknadstransaktioner som inte omfattas av definitionen av transaktion för värdepappersfinansiering

- 11. Följande transaktioner omfattas inte av definitionen av transaktion för värdepappersfinansiering och rapporteras inte enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.
 - a. Utlåning till privata klienter som regleras av lagstiftningen om konsumentkredit.

- b. Private banking-lån och lombardlån utan anknytning till värdepappersfinansiering.
- c. Syndikerad utlåning och annan företagsutlåning i kommersiellt syfte.
- d. Depåbankers kontokredit och centrala motparters dagsutlåning.
- e. Intradagskredit/-kontokredit för kompensering för utebliven avveckling.
- f. Centralbankens automatiska säkerheter.
- g. Överföring av transaktioner i genomförande- och clearingkedjan.
- h. Transaktioner med råvaror ingångna för operativa och/eller industriella ändamål.
- i. Transaktioner som inbegriper utsläppsrätter.

4.2.2 Aspekter kring alla typer av transaktioner för värdepappersfinansiering

12. En part i en transaktion för värdepappersfinansiering som agerar i eget namn och utför transaktioner för egen räkning anses som motpart i en transaktion för värdepappersfinansiering.
13. En enhet som bidrar till, organiserar eller deltar i ingåendet av en transaktion för värdepappersfinansiering, antingen på låne- eller på säkerhetssidan, dock varken i eget namn eller för egen räkning utan som agerar för en klients räkning, bör inte anses som motpart utan som mäklare, ombud till en långivare, trepartsagent eller deltagare i central värdepapperscentral, enligt vad som är tillämpligt. En enhet kan ha flera roller i en transaktion för värdepappersfinansiering. Hur uppgifterna om motparten bör fyllas i beskrivs närmare i avsnitt 5.1.
14. Därför är motparter skyldiga att ange vilken typ av transaktion för värdepappersfinansiering som de har ingått. På liknande sätt används inte alla fält vid alla transaktioner för värdepappersfinansiering, såsom beskrivs i bilaga 1 till de tekniska tillsynsstandarderna för rapportering och i avsnitt 5.2 i detta dokument. Därför bör motparterna vara helt ense om typen av den ingångna transaktionen för värdepappersfinansiering.
15. En transaktion för värdepappersfinansiering omfattas av rapporteringsskyldighet om den har två motparter eller om en av parterna i transaktionen är en individ som inte är något företag och den andra är en motpart enligt definitionen i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering. Inga transaktioner för värdepappersfinansiering kan ha fler än ett par motparter. Vid fördelning av lån mellan två eller fler säkerhetstagare och två eller fler säkerhetsställare definieras en transaktion för värdepappersfinansiering som varje säkrat lån av värdepapper, kontanter eller råvaror mellan två motparter.
16. Investeringsfonder anses som motparter i transaktioner för värdepappersfinansiering om kriterierna i punkt 12 är uppfyllda, oavsett fondens juridiska karaktär. När det gäller delfonder har de i regel egen LEI-kod, på liknande sätt som vid tillämpning av Emir. I detta fall bör delfonden rapporteras som självständig motpart. Relevanta uppgifter om lån och säkerhet bör avse transaktioner för värdepappersfinansiering som ingåtts av denna delfond. Om delfonden inte är någon part i transaktionen för värdepappersfinansiering, se avsnitt 4.17.

17. Vid clearade transaktioner för värdepappersfinansiering utgör varje transaktion för värdepappersfinansiering mellan den centrala motparten, dess clearingmedlemmar och deras klienter osv. en separat transaktion för värdepappersfinansiering och bör rapporteras med egen unik transaktionsidentifierare (UTI-kod). Om transaktionen för värdepappersfinansiering ingås på en handelsplats och clearas samma dag enligt artikel 2.2 i de tekniska tillsynsstandarderna för rapportering, bör den rapporteras efter clearing, vilket innebär att interna överföringar inte bör rapporteras. Se avsnitt 4.3 för närmare information om rapportering av clearade transaktioner för värdepappersfinansiering.
18. Vid transaktioner för värdepappersfinansiering som gäller kompensering för utebliven avveckling bör den centrala värdepapperscentralen ange de aktuella deltagarna i den centrala värdepapperscentralen (och inte klienterna till dessa) som sina motparter. Detta gäller även när transaktionen för värdepappersfinansiering ingås mot ett samlingskonto.
19. Därför bör alla andra transaktioner för värdepappersfinansiering utom de som avses i artikel 2.3 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering och i avsnitt 4.2.1 rapporteras i enlighet med det härpå följande avsnittet i dessa riktlinjer.
20. Det bör noteras att de transaktioner för värdepappersfinansiering som avses i artikel 2.3 omfattas av rapporteringsskyldigheten enligt förordning 600/2014.

4.2.3 Aspekter kring repor

21. Vid säkrade lån i fler än en valuta utgör dessa separata transaktioner för värdepappersfinansiering och bör rapporteras med olika UTI-koder. Varje repa rapporteras i enlighet med de allmänna principerna för rapportering av repotransaktioner:
 - a. Rapportera de tillämpliga kapitalbeloppen, UTI-koderna och eventuella individuella säkerhetskomponenter för varje valuta, och
 - b. rapportera den aktuella säkerheten på nettoexponeringsbasis, dvs. den säkerhet som täcker reporna men inte har tilldelats någon av reporna, och se till att den kan länkas via de relevanta fälten.
22. Om repopriset uttrycks i en annan valuta än den som användes i köpriset men ändå avser samma repa bör valutan för slutdelen omräknas till valutan för den inledande delen i samband med rapporteringen av relevanta uppgifter om pris och kapitalbelopp. Se riktlinjen om tillämpning av växelkurser vid rapportering av marknadsvärden i avsnitt 4.13.1 för att säkerställa att korrekta siffror anges i detta fält.
23. Om repans säkerhet överförs på ett annorlunda sätt som ändå ingår i de säkerhetsarrangemang som definieras i säkerhetsdirektivet, bör motparterna ändå rapportera den som repa. Repor som ingås i enlighet med regler i andra jurisdiktioner, t.ex. "gentan-repor", bör rapporteras därefter och genom att ange fullständiga och korrekta uppgifter i enlighet med de tekniska standarderna för rapportering.
24. Repor och omvända repor ingångna av centrala motparter för investering i) av egna tillgångar för upprätthållande av likviditet eller ii) av clearingmedlemmars tillgångar som marginalsäkerhet, omfattas av rapporteringsskyldighet enligt artikel 4 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.

25. Repor eller omvända repor bör rapporteras med XML-mallen enligt ISO 20022 som tillämpas på repor.

4.2.4 Aspekter kring köp- och återförsäljningstransaktioner respektive sälj- och återköpstransaktioner

26. Vissa köp- och återförsäljningstransaktioner samt sälj- och återköpstransaktioner regleras av bilaterala avtal eller ramavtal. Specifika bilagor om dessa transaktioner för värdepappersfinansiering skiljer sig emellertid från de bilagor som reglerar repor och omvända repor. Den ingångna transaktionen för värdepappersfinansiering är utan tvivel av typen köp- och återförsäljningstransaktion eller sälj- och återköpstransaktion.
27. Om köp- och återförsäljningstransaktionen eller sälj- och återköpstransaktionen regleras av ettilateralt avtal eller ramavtal eller av en bilaga till ett ramavtal bör detta avtal anges i relevanta fält, nämligen i fält 9–11 i tabell 2 om uppgifter om lån och säkerhet.
28. Motparterna bör sträva efter att rapportera ramavtal som inte inkluderas i de tekniska genomförandestandarderna för rapportering på exakt samma sätt. Vid ramavtal bör även fältet "Ramavtal, version" rapporteras med angivelse av den version som gäller för den aktuella transaktionen för värdepappersfinansiering.
29. Om motparterna anser att det är bättre att rapportera vissa typer av köp- och återförsäljningstransaktioner och/eller sälj- och återköpstransaktioner med repomallen och om båda motparter samtycker till detta bör motparterna använda repomallen för rapportering av dessa transaktioner för värdepappersfinansiering.
30. Köp- och återförsäljningstransaktionerna och/eller sälj- och återköpstransaktionerna bör rapporteras med den XML-mall enligt ISO 20022 som tillämpas på köp- och återförsäljningstransaktioner samt sälj- och återköpstransaktioner.

4.2.5 Aspekter kring utlåning och inlåning av värdepapper

31. I enlighet med definitionen innebär ingående av ett avtal om utlåning eller inlåning av värdepapper en överföring av värdepapper från en långivare till en låntagare. En utlåning eller inlåning av värdepapper kan inte avse överföring av fler än en ISIN-kod. Vid tilldelning utförd av tredjepartsenheter (såsom ombud för långivare) där flera ISIN-koder ska överföras mellan ett visst par motparter, bör en separat transaktion för värdepappersfinansiering rapporteras för varje ISIN-kod.
32. Eftersom artikel 4.1 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering kräver rapportering av ingående, ändring och avslutande av transaktioner för värdepappersfinansiering senast nästa arbetsdag bör alla ingångna transaktioner för värdepappersfinansiering rapporteras. Detta inbegriper alla genererade transaktioner för värdepappersfinansiering, även om de inte har avvecklats.
33. Vissa typer av tillgångsförvaltare har inte beaktats i de olika scenarierna, exempelvis fonder som aggregerar värdepapper i en grupp av tillgångar och kan låna ut dem. Dessa fonder handlar via en mäklare som agerar som agent och lånar ut ett värdepapper för en viss volym från fondens grupp av tillgångar. En direkt transaktion bekräftas mellan motparten och gruppen. Den slutliga tilldelningen utförs vid slutet av dagen och

individuella bekräftelser skickas till varje fond som deltar i gruppen. Uppgifterna skickas även till motparten och avveckling sker genom en enda överföring från det gemensamma förvaringsinstitutet för alla berörda fonder. I detta särskilda fall och i enlighet med den allmänna principen enligt punkt 15 rapporterar motparterna en separat transaktion för värdepappersfinansiering för varje par av motparter och ISIN till transaktionsregistren.

34. Vid utlåning av värdepapper med en central motpart och en tillgångsgrupp kan intradags livscykelaktivitet inte rapporteras om bara nya nettolånepositioner tilldelas låntagaren och långivaren vid slutet av dagen. Därför bör intradagslån rapporteras vid en central motpart, även om de inte nödvändigtvis har någon tilldelad säkerhet. Säkerheter bör rapporteras vid alla andra utlåningar och inlåningar av värdepapper om fält 2.72 "Indikator för värdepappersfinansiering utan säkerhet" fylls i med "felaktig" (false), bl.a. vid avvecklade nya nettolån som ska rapporteras i transaktionsrapporten (på S+1).
35. Utlåning och inlåning av värdepapper bör rapporteras med den XML-mall enligt ISO 20022 som tillämpas på utlåning och inlåning av värdepapper.
36. Kontantbaserad utlåning och inlåning av värdepapper, även känd som "omvända värdepapperslån" ska rapporteras som repa. Om repofälten används vid rapportering av kontantbaserad utlåning och inlåning av värdepapper bör det observeras att ramavtalstypen bör motsvara det relevanta underliggande avtalet, t.ex. ett globalt ramavtal för värdepapperslån (GMSLA).

4.2.6 Aspekter kring transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror

37. Genomförande av transaktioner för värdepappersfinansiering bör struktureras så att den förmånstagande ägaren varken förlorar sin ekonomiska äganderätt över råvarorna eller tar någon ny marknadsrisk i råvarorna.
38. Repotransaktioner/omvända repotransaktioner som inbegriper råvaror kännetecknas av ett (repo)avtal. Råvarorna kan överföras genom äganderättsöverföring eller pantsättning.
39. Vid transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror gäller dock att om försäljning och återköp inte uppfyller kriterierna för repotransaktion bör denna i stället betraktas som en köp- och återförsäljningstransaktion.
40. Vid en transaktion för utlåning och inlåning av råvaror är säkerhetstagaren den part som lånar ut råvarorna och säkerhetsställaren lånar råvarorna. Vid repa/omvänd repa och vid köp- och återförsäljningstransaktioner/sälj- och återköpstransaktioner betraktas råvaran däremot som säkerheten i transaktionen.
41. Vid rapportering av transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror bör motparterna utöver hänsyn till aktuella ramavtal också bedöma i vilken mån den rapporterade typen av transaktioner för värdepappersfinansiering med råvaror kan passa i de fält som används vid denna transaktion för värdepappersfinansiering. Detta bör vara till hjälp för att fastställa huruvida transaktionen behöver rapporteras som en transaktion för utlåning eller inlåning av råvaror eller som en repa/sälj- och återköpstransaktion eller som en omvänd repa/köp- och återförsäljningstransaktion säkrad med råvaror.
42. Dessutom finns det i alla transaktioner för värdepappersfinansiering enligt definitionen i artiklarna 3.7–3.10 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappers-

finansiering (utom marginalutlåning) en möjlighet att använda råvaror som en del av transaktionen för värdepappersfinansiering. Köp- och återförsäljningstransaktioner samt sälj- och återköpstransaktioner begränsar användningen av råvaror till köp och påföljande försäljningar mellan de två motparterna (utan marknadsintermediär) medan transaktioner för ut- och inlåning av råvaror och repor medger såväl äganderättsöverföring som pantsättning. Därför bör motparterna i förekommande fall fylla i typen av säkerhetsarrangemang i fält 2.20 "Metod för ställande av säkerhet".

43. Transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror kan ibland vara en del av mer komplexa strukturer som kan inbegripa derivat såsom terminer och optioner. Endast de delar av den allmänna strukturen som utgör transaktioner för värdepappersfinansiering bör rapporteras. Derivat som används i sådana strukturer kan rapporteras i enlighet med Emir och/eller Mifid och/eller Remit.
44. Vad gäller innebörden av likvärdiga råvaror och ersättningsråvaror gör Esma följande förtydligande:
 - a. Likvärdiga råvaror är samma typ av råvaror med liknande egenskaper och/eller specifikationer som enligt avtal kan ersätta de ursprungliga råvarorna i etappen för återlämnande.
 - b. Ersättningsråvaror är råvaror pantsatta som säkerhet som ersättning för råvaror som ursprungligen pantsattes som säkerhet inom ramen för samma transaktion.

4.2.6.1 Transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper energi

45. En transaktion (t.ex. köp och återförsäljning av gas mellan zoner med [alternativa] finansieringsmål) kan vara en transaktion som rapporteras i enlighet med Remit med en rapporteringsperiod på T+30 och samtidigt en transaktion för värdepappersfinansiering som rapporteras till T+1.
46. Om dessa typer av transaktioner är tillräckligt tydliga för entydig klassificering som transaktioner för värdepappersfinansiering som används för finansiering av råvaror ska de därför rapporteras enligt relevant rapporteringsmall.

4.2.7 Aspekter kring marginalutlåning

47. Det väntas endast finnas en marginalutlåningstransaktion mellan varje par av motparter vid varje given tidpunkt, utom i fall där enheterna avtalar om att använda fler än en basvaluta och marginallånen fastställs i varje basvaluta; i så fall bör det finnas en separat marginalutlåningstransaktion för varje basvaluta. Denna transaktion för värdepappersfinansiering avser varje marginallån eller marknadsvärde för korta positioner i basvalutan.
48. UTI-koder för marginalutlåning bör endast genereras när krediten har utnyttjats minst en gång. Om ett avtal om marginalutlåning har tecknats men krediten ännu inte har utnyttjats krävs det ingen rapport eftersom ingen transaktion för värdepappersfinansiering ännu finns i det skedet.
49. Om både marginallånet och marknadsvärdet för korta positioner vid någon tidpunkt minskar till noll, vilket innebär att ingen kredit i kontanter eller värdepapper tillhandahålls,

säkrar klientens säkerhet hos prime broker-institutet inte längre exponeringen av transaktioner för värdepappersfinansiering. Den reserveras för andra skyldigheter utanför transaktioner för värdepappersfinansiering. Prime broker-institutet och klienten bör i) upphöra med rapportering av säkerheten tills marginallånet eller SMV-exponeringen återfinns eller ii) rapportera kontantsäkerheten som noll för att ange att säkerhet saknas.

50. Transaktionen bör inte rapporteras med åtgärdstypen "ETRM", utan med åtgärdstypen "MODI". I detta fall förväntas även ett meddelande om uppdatering av säkerhet (COLU) där värdet för kontantsäkerhet anges som noll för att undvika felaktigt angivande av den aktuella säkerheten. För rapportering av nollsäkerhet, se avsnitt 5.4.4.
51. Vid marginallån bör motparterna inte rapportera säkerhetskomponenter som inte är värdepapper eller kontanter.
52. Rapportering av klientens marknadsvärde för korta positioner bör inte baseras på redovisning (dvs. redovisning av antingen transaktionsdagen eller avvecklingsdagen) av prime broker-institutet (IAS 39.38 Finansiella instrument: Redovisning och värdering). Marknadsvärdet för korta positioner bör rapporteras på samma sätt som avvecklingen av lånet och säkerheten. Motparterna bör således beräkna marknadsvärdet för korta positioner utifrån den avsedda avvecklingsdagen och de säkerheter som man väntas tillhandahålla.
53. Vidare gäller att om marginallåneklientens portfölj inte inkluderar handel med värdepapper har rapportering av kredit till dessa kunder ingen betydelse med avseende på förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering och bör undvikas för att förhindra insamling av stora mängder onödigt information.

4.3 Rapportering av transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart

54. Rapportering på positionsnivå används vid transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart; den är frivillig och kompletterar rapporteringen på transaktionsnivå. Rapporten på positionsnivå kan lämnas in om vissa villkor är uppfyllda¹.
 - a. Den juridiska konstruktionen avser att risken gäller på positionsnivå, alla transaktionsrapporter avser produkter som är fungibla, och enskilda transaktioner har ersatts med positionen. Detta gäller vid novation efter nettnings av enskilda transaktioner; den nettade positionen resulterar i ett nytt avtal och en ny UTI genereras för den. Detta kan exempelvis förekomma mellan en clearingmedlem och en central motpart.
 - b. De ursprungliga transaktionerna har rapporterats korrekt, dvs. på transaktionsnivå. Rapportering av enbart positioner är inte tillåten.
 - c. Andra händelser som påverkar de gemensamma fälten i positionsrapporten rapporteras separat.

¹ Se avsnitt 84 i samrådsdokumentet om rapportering enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.

- d. De ursprungliga transaktionsrapporterna (punkt b ovan) och rapporter om andra händelser (punkt c ovan) har i förekommande fall uppnått ett lämpligt "slut av livscykeln". Detta borde uppnås genom att skicka meddelanden om förtida avslut och sedan rapportera nettopositionen antingen som en ny position eller som uppdatering av den befintliga positionen.
 - e. Rapporten om positionen upprättas korrekt genom ifyllande av alla tillämpliga fält för motpartsspecifika uppgifter och transaktionsuppgifter och i förekommande fall fält i tabeller för marginalsäkerhet och återanvändning.
55. Om dessa villkor är uppfyllda kan senare ändringar, bland annat uppdateringar av värdering och säkerhet samt andra ändringar och livscykelhändelser, rapporteras genom positionsrapporten (som ändringar osv.) och med samma UTI-kod för positionen clearad av en central motpart, inte genom rapporter om ursprungliga transaktioner/händelser.
56. Rapporten på positionsnivå bör identifieras med en egen UTI som är en fast beteckning för denna position, vilket innebär att den inte ändras efter eventuella modifieringar av positionen.
57. En återinförd regel är att clearade transaktioner för värdepappersfinansiering först bör rapporteras på transaktionsnivå med åtgärdstypen "POSC" (även om de clearades samma dag) för att rapportering på positionsnivå ska kunna ske; först därefter kan livscykelhändelser rapporteras på positionsnivå. Se avsnitt 5.2.1 för scenariot som illustrerar de erforderliga stegen för rapportering på positionsnivå.

4.4 Ansvarsfördelning enligt artikel 4.3 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering

4.4.1 Det allmänna fallet

58. En icke-finansiell motpart bör meddela den finansiella motparten om den klassificeras som ett litet icke-finansiellt företag eller inte, samt uppdatera den finansiella motparten om eventuella förändringar i sin status.

4.4.2 Finansiella motparter i tredje länder (TC-FC)

59. När Europeiska unionen har godkänt likvärdigheten av ett tredje land vid en transaktion för värdepappersfinansiering mellan en finansiell motpart i ett tredje land (TC-FC) med en filial i unionen och ett litet eller medelstort (SMF) icke-finansiellt företag där TC-FC och den icke-finansiella SMF-motparten har fullgjord rapporteringsskyldigheterna i det tredje landet bör varken TC-FC eller den icke-finansiella motparten rapportera transaktionen för värdepappersfinansiering enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.
60. Vad gäller transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna mellan en TC-FC som inte omfattas av förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering (och därmed inte omfattas av artikel 2.1 a ii i förordningen) och en icke-finansiell SMF-motpart, bör denna icke-finansiella motpart antingen rapportera sådana transaktioner för



värdepappersfinansiering direkt till ett transaktionsregister eller använda möjligheten till delegering enligt artikel 4.2.

4.4.3 Fonder

61. Om ansvarsfördelning enligt artikel 4.3 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering inte tillämpas på AIF-förvaltaren, dvs. om AIF-förvaltaren inte omfattas av förordningen, förblir fonden ansvarig för rapportering av transaktioner för värdepappersfinansiering till ett transaktionsregister.

4.5 Frivillig delegering av rapportering

62. Vid delegering av rapportering bör den delegerande motparten (den som har rapporteringsskyldigheten) tillhandahålla den rapportinlämnande enheten alla uppgifter om transaktionen för värdepappersfinansiering i tid och motparten ansvarar för kontroll av att uppgifterna är korrekta. Samtidigt bör den rapportinlämnande enheten säkerställa att de rapporterade motparterna underrättas om uppgifter som rapporterades för deras räkning, aktuella resultat av transaktionsregisters databehandling och eventuella relevanta problem med rapportering eller kvalitet av uppgifter.

4.6 Tillämpning av rapporteringsskyldighet enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering på transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna av filialer

4.6.1 Tillämpning av rapporteringsskyldighet enligt förordningen när det gäller transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna av enheter utanför EU med filialer i EU

63. I enlighet med syftet med förordningen och i överensstämmelse med Emir anser Esma att termen "ingående" ska tolkas i förhållande till motparten i transaktionen, dvs. den motpart hos vilken transaktionen för värdepappersfinansiering är registrerad.

4.6.2 Fastställande av rapporteringsskyldighet för transaktioner för värdepappersfinansiering ingångna mellan filialer

64. Tabell 1 förklarar vad som bör rapporteras med avseende på filialer till rapporterande motparter.
65. I den sista kolumnen, med rubriken "Rapporteras enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering", anges huruvida transaktionen omfattas av rapporteringsskyldighet enligt förordningen. Om transaktionen inte omfattas av rapporteringsskyldighet bör den inte rapporteras, oavsett var motparterna/filialerna finns. De röda raderna i Tabell 1 visar scenarier som aldrig ska rapporteras enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.

66. Det är viktigt att förstå att vid vissa scenarier betyder inte det faktum att motparten har rapporteringsskyldighet att transaktionen för värdepappersfinansiering behöver rapporteras, och omvänt, såsom förklaras i Tabell 1. Till exempel ska transaktioner mellan två filialer inom samma juridiska enhet inte rapporteras även om motparten (identifierad med LEI 1) omfattas av rapporteringsskyldighet, såsom visas i den sista kolumnen. Anledningen är att det inte finns två motparter utan snarare två förgreningar av samma motpart.
67. Även om en filial har en LEI-kod bör fält 1.3 "Rapporterande motpart" och fält 1.11 "Den andra motparten" fyllas i med LEI-koden för respektive huvudkontor, medan information om relevanta filialer bör rapporteras i fält 1.7 "Filial till den rapporterade motparten" och fält 1.8 "Filial till den andra motparten". Fält 1.12 "Den andra motpartens land" bör fyllas i med landskoden för huvudkontoret, inte den för filialen.

Tabell 1 – Rapportering av filialer									
	Reporting Counterparty	Country of the reporting counterparty	Country of the branch of the reporting counterparty	Reporting obligation	Other Counterparty	Country of the other counterparty	Country of the branch of the other counterparty	Reporting obligation	Reportable under SFTR
SFT1	LEI1	EU		YES	LEI1	EU	AT	YES	NO
SFT2	LEI1	EU		YES	LEI1	EU	US	YES	NO
SFT3	LEI1	EU	BE	YES	LEI1	EU	AT	YES	NO
SFT4	LEI1	EU	BE	YES	LEI1	EU	US	YES	NO
SFT5	LEI1	EU	CH	YES	LEI1	EU	US	YES	NO
SFT6	LEI1	EU		YES	LEI2	EU		YES	YES
SFT7	LEI1	EU		YES	LEI2	EU	AT	YES	YES
SFT8	LEI1	EU		YES	LEI2	EU	US	YES	YES
SFT9	LEI1	EU	BE	YES	LEI2	EU		YES	YES
SFT10	LEI1	EU	BE	YES	LEI2	EU	AT	YES	YES
SFT11	LEI1	EU	BE	YES	LEI2	EU	US	YES	YES
SFT12	LEI1	EU	US	YES	LEI2	EU		YES	YES
SFT13	LEI1	EU	US	YES	LEI2	EU	AT	YES	YES
SFT14	LEI1	EU	US	YES	LEI2	EU	US	YES	YES
SFT15	LEI1	EU		YES	LEI3	US		NO	YES
SFT16	LEI1	EU		YES	LEI3	US	CH	NO	YES
SFT17	LEI1	EU		YES	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT18	LEI1	EU	BE	YES	LEI3	US		NO	YES
SFT19	LEI1	EU	BE	YES	LEI3	US	CH	NO	YES
SFT20	LEI1	EU	BE	YES	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT21	LEI1	EU	US	YES	LEI3	US		NO	YES
SFT22	LEI1	EU	US	YES	LEI3	US	CH	NO	YES
SFT23	LEI1	EU	US	YES	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT24	LEI4	US		NO	LEI3	US		NO	NO
SFT25	LEI4	US	AT	YES	LEI3	US		NO	YES
SFT26	LEI4	US	CH	NO	LEI3	US		NO	NO
SFT27	LEI4	US		NO	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT28	LEI4	US	AT	YES	LEI3	US	AT	YES	YES

Tabell 1 – Rapportering av filialer

	Reporting Counterparty	Country of the reporting counterparty	Country of the branch of the reporting counterparty	Reporting obligation	Other Counterparty	Country of the other counterparty	Country of the branch of the other counterparty	Reporting obligation	Reportable under SFTR
SFT29	LEI4	US	CH	NO	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT30	LEI4	US		NO	LEI3	US	CH	NO	NO
SFT31	LEI4	US	AT	YES	LEI3	US	CH	NO	YES
SFT32	LEI4	US	CH	NO	LEI3	US	CH	NO	NO
Note: AT and BE are ISO 3166-1 Alpha-2 codes for EU member states, US and CH are ISO 3166-1 Alpha-2 codes for non-EU member states.									
All codes are included for illustrative purposes.									
If the country of the branch is not provided, it should be interpreted that the SFT was concluded by the headquarters.									
The reporting of the data elements in italics might not be required.									

4.7 Rapportering av en icke-finansiell motpart

68. Esma erkänner att en LEI-kod ibland kan vara otillgänglig i vissa scenarier; detta scenario används emellertid inte vid icke-finansiella motparter etablerade i EU. Alla enheter som omfattas av förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering bör använda LEI-koder för identifiering av de enheter som anges i de relevanta datafälten.
69. Om transaktionen för värdepappersfinansiering ingås mellan två icke-finansiella motparter bör båda rapportera den till ett transaktionsregister, även om de kan använda möjligheten att delegera rapporteringen till endera part eller till en tredje part enligt artikel 4.2.

4.8 Åtgärdstyper

4.8.1 Tillämpliga åtgärdstyper

70. Motparterna i en transaktion för värdepappersfinansiering bör rapportera ingående, ändring och avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering. Om inga uppgifter om transaktionen för värdepappersfinansiering (som de uttrycks i datafälten) har ändrats behöver motparterna inte rapportera uppgifterna om transaktionen för värdepappersfinansiering på nytt.
71. Uppdateringar av värdering bör endast rapporteras vid ändring i värdet på utlånade värdepapper eller värdepapper ställda som säkerhet.
72. Vid rapportering av säkerhet behöver motparterna inte rapportera eventuella intradagsändringar i säkerheten, utan endast läget vid slutet av dagen.
73. Olika åtgärdstyper utesluter varandra. Beroende på vilken åtgärdstyp som väljs ger rapporteringen olika typer av information ur affärs- och dataförvaltningsynpunkt till myndigheterna. Därför bör motparterna sträva efter att välja rätt åtgärdstyp för sin rapportering.

4.8.2 Fullständig eller delvis rapportering av ändringar i transaktioner för värdepappersfinansiering

74. Vid ändringar i transaktioner för värdepappersfinansiering (både livscykelhändelser och rättelser) bör motparterna lämna in meddelanden som innehåller alla tillämpliga fält, inbegripet de fält som inte har ändrats, så att uppgifter om lån och säkerhet fortfarande kan rapporteras separat.
75. Vidare bör det noteras att uppdateringar av värdering, säkerhet, marginalsäkerhet och återanvändning är dagliga lägesrapporter, och i denna typ av rapporter krävs det att alla relevanta fält fylls i. Eftersom rapportering sker på daglig basis förväntas det att varje lägesrapport speglar läget vid dagens slut med beaktande av alla relevanta ändringar under denna dag. Följaktligen, och med hänsyn till rapporteringstiden T+1, förväntas en motpart inte lämna in en korrigeringsrapport för säkerhet, värdering, marginalsäkerhet eller återanvändning för den aktuella dagen eller den föregående arbetsdagen. Rättelser på områdena säkerhet, värdering, marginalsäkerhet eller återanvändning bör i stället endast lämnas in för historiska data om ett fel upptäcks i rapporterad information efter utgång av rapporteringstidsfristen.
76. Om det är aktuellt med information om transaktionens lånesida bör varje ändring rapporteras som sådan och separat från rättelserna på lånesidan. Vid olika ändringar som äger rum samma dag kan de rapporteras i en enda rapport i den mån som rapporten speglar alla ändringar korrekt.
77. De exakta fält som krävs för varje rapporttyp anges i valideringsreglerna.
78. Vad gäller vissa fält som inte bör modifieras (t.ex. "Genomförandetillfälle") förväntas inte transaktionsregistren verifiera att innehållet i dessa fält är oförändrat vid rapportering med åtgärdstypen "MODI", utom om annat anges i valideringsreglerna för ett visst fält.

4.8.3 Ordningsföljden av åtgärdstyper för olika typer av meddelanden

79. Tabell 2, Tabell 3 och Tabell 4 ger information om de olika kombinationerna av ordningsföljden för åtgärdstyper som inte är förbjudna enligt valideringsreglerna². Informationen i Tabell 2 gäller för rapportering på transaktions- och positionsnivå³, medan Tabell 3 och Tabell 4 specifikt avser rapportering av marginalsäkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart och rapportering av återanvändning.

² Framtida ändringar av definitionen i valideringsreglerna kan påverka tabellens innehåll.

³ Positionskomponent används inte vid rapportering på positionsnivå

Tabell 2 – Uppgifter om motpart, lån och säkerhet

		Following Steps							
		New	Error	Termination	Modification	Valuation	Collateral	Correction	Position Component
Previous steps	New		x	x	x	x	x	x	
	Error								
	Termination		x		x	x	x	x	
	Modification		x	x	x	x	x	x	
	Valuation		x	x	x	x	x	x	
	Collateral		x	x	x	x	x	x	
	Correction		x	x	x	x	x	x	
	Position Component		x					x	

Tabell 3 – Uppdatering av marginalsäkerhet

		Following step			
		New	Error	Margin update	Correction
Previous step	New		x	x	x
	Error				
	Margin update		x	x	x
	Correction		x	x	x

Tabell 4 – Uppgifter om återanvändning, återinvestering av kontanter och finansieringskällor

		Following step			
		New	Error	Reuse update	Correction
Previous step	New		x	x	x
	Error				
	Reuse update		x	x	x
	Correction		x	x	x

80. Vid användning av Tabell 2, Tabell 3 och Tabell 4 är det viktigt att förstå att de representerar åtgärdstyper som kan rapporteras vid valfri tidpunkt efter inlämnandet av någon annan åtgärdstyp, och därmed inte bara utgör det omedelbart efterföljande tillåtna steget. Exempel: Efter att en rapport med åtgärdstypen "Positionskomponent" har skickats in är det endast tillåtet att skicka in en "Rättelse" (Correction) eller ett "Fel" (Error). Efter inlämnande av en rättelse är dock varje annan typ av rapport tillåten. En fråga som kan uppstå är följande: Kan en enhet som har skickat in en rapport med åtgärdstypen "Positionskomponent" och sedan skickat in en "Rättelse" för samma UTI-kod fortsätta att skicka in rapporter med andra åtgärdstyper? Svaret är nej. Åtgärdstypen "Rättelse" upphäver/avskaffar inte de logiska begränsningar som följer av tidigare inlämnande av rapporten med åtgärdstypen "Positionskomponent". Därför kan enheten fortfarande endast lämna in ett meddelande om "Fel" eller "Rättelse" för samma åtgärdstyp. På liknande sätt behöver man inte avsluta transaktionen för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut" på nytt efter inlämnande av korrigerande för en tidigare avslutad transaktion för värdepappersfinansiering (eftersom "Rättelse" inte påverkar transaktionens icke-utestående status).
81. Anledningen till att "Fel" och "Rättelse" är de enda acceptabla åtgärdstyperna efter rapportering med åtgärdstypen "Positionskomponent" är att när transaktionen för värdepappersfinansiering ingår i positionen bör alla efterföljande rapporter (inbegripet uppdateringar av säkerhet) vara på positionsnivå. Därför bör rapporter lämnas in med en annan UTI-kod (positionens UTI-kod) och den korrekta ordningsföljden för dessa rapporter för positionen bör också kontrolleras.
82. Rapporterna om transaktioner för värdepappersfinansiering bör skickas i kronologisk ordningsföljd för händelserna, i enlighet med kraven i de tekniska

genomförandestandarderna. Det erkänns emellertid att om en enhet underlåter att rapportera i tid eller upptäcker fel i tidigare inlämnade uppgifter bör enheten skicka in rapporterna med händelsedatum i det förflutna och således avbryta den kronologiska ordningsföljden.

83. Transaktionsregistren behöver emellertid endast kontrollera "Händelsens datum" för att fastställa att det inte är ett framtida datum (detta anges uttryckligen i valideringsreglerna) och
 - a. vid händelsedatum "i det förflutna" (dvs. tidigare än rapporteringsdagen -1) ändrar dessa händelser inte transaktioner efter deras förfallodag eller avslutande, dvs. att det rapporterade händelsedatumet är tidigare än förfallodagen och eventuellt datum för avslutande (detta återges även i valideringsreglerna). Transaktionsregister bör även kontrollera att ändringar skickade med händelsens datum i det förflutna inte ändrar den tidigare rapporterade förfallodagen. Vidare bör inte transaktionsregistren föra in den rapporterade ändringen i den aktuella rapporten om transaktionsläge (om transaktionen är utestående) eller i den tidigare rapporten om transaktionsläge för den dag då händelsen rapporterades.
 - b. Om händelsedatumet sammanfaller med rapporteringsdatumet eller dagen före rapporteringsdatumet bör transaktionsregistret införa ändringar i rapporten om transaktionsläge med utgångspunkt i ordningsföljden för inlämnandet.
84. Transaktionsregistren bör lämna in alla godkända rapporter om transaktionsaktivitet till myndigheterna, oavsett händelsedatum.
85. Transaktionsregistren bör validera rapporternas korrekta ordningsföljd utifrån ordningsföljden för deras inlämnande, oavsett innehållet i fältet "Händelsens datum".
86. Eftersom vissa händelser i det förflutna kan rapporteras för transaktioner som har löpt ut eller avslutats är det tillåtet att skicka in "Ändring", "Uppdatering av värdering" eller "Uppdatering av säkerhet" efter en rapport med "Avslut/förtida avslut" (så länge händelsens datum ligger före förfallodagen/datumet för avslutande); detta återges i Tabell 2.
87. Det bör noteras att rapportering av ersättning av säkerhet efter avslutandehändelsen inte förväntas (utom om avslutet upphävs). Därför bör avslutandet inte rapporteras före datumet för ikraftträdande för avslutet (se avsnitt 4.9.5 för närmare information om rapportering av avslut).
88. Om flera tidigare rapporter har avvisats av ett transaktionsregister bör motparten korrigera och återsända dem snarast och upprätthålla händelsernas kronologiska ordning. Om de tidigare rapporterna avsåg händelser på rapporteringsdagen eller dagen före och därför tas i beaktande av transaktionsregistret inom ramen för rapporten om transaktionsläge (enligt avsnitt 83 ovan), kan motparten även behöva lämna in den/de senaste rapporten/rapporterna på nytt för att uppdatera registreringen av transaktionen till det senaste läget.
89. Vid åtgärdstypen "Fel" är det viktigt att observera att en rapport inte kan upphävas eller "återkallas". Om en av de två motparterna skickar in en rapport med denna åtgärdstyp av misstag bör motparterna göra enligt följande för fortsatt korrekt rapportering:

- a. Den andra motparten bör också sända en rapport med åtgärdstypen "Fel" för samma UTI-kod. Denna UTI-kod kan inte längre användas.
 - b. Båda motparterna bör komma överens om en ny UTI-kod för transaktionen, rapportera den med åtgärdstypen "Ny" och den överenskomna nya UTI-koden och fortsätta rapportering av eventuella senare livscykelhändelser med denna nya UTI-kod.
90. Ett undantag där inlämnande av åtgärdstypen "Fel" inte nödvändigtvis kräver upphävande av transaktionen av den andra motparten är ett potentiellt scenario där en av motparterna av misstag rapporterar transaktionen två gånger till två olika transaktionsregister och vill upphäva en av dem för att den är överflödig. I detta fall bör denna motpart skicka en rapport med åtgärdstypen "Fel" till det enda transaktionsregistret, medan samma transaktion förblir öppen hos det andra transaktionsregistret och båda motparter kan fortsätta rapportera med samma UTI-kod.
91. Det bör även noteras att denna begränsning inte tillämpas på rapportering av marginalsäkerheter och återanvändning. Till exempel kan en motpart rapportera återanvändning av misstag (om återanvändning inte har skett). Om så är fallet bör denna motpart lämna in en återanvändningsrapport med åtgärdstypen "Fel". Detta hindrar emellertid inte motparten från att rapportera återanvändning vid ett senare tillfälle vid behov.

4.9 Rapportering i god tid av ingående, modifiering och avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering

4.9.1 Ingående av en transaktion för värdepappersfinansiering

92. Om en transaktion för värdepappersfinansiering ingås och sedan avslutas (bl.a. om den avslutas på grund av utebliven avveckling) bör motparterna efter rapportering med åtgärdstypen "Ny" rapportera den med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut". Om den ursprungliga transaktionen för värdepappersfinansiering rapporterades med åtgärdstypen "Positionskomponent" och sedan avslutas bör motparterna inte skicka en rapport med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut" för den ursprungliga transaktionen för värdepappersfinansiering; i stället bör motparterna skicka en rapport med åtgärdstypen "Ändring" för den position där den ursprungliga transaktionen ingick, för att ta bort denna transaktion för värdepappersfinansiering från positionen.
93. Åtgärdstypen "Fel" bör endast användas för att annullera transaktion som aldrig kom till stånd eller som inte omfattas av rapporteringskrav enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering. I ett scenario där motparterna kommer överens om en transaktion som är beroende av registrering med den centrala motparten och denne avvisar transaktionen, bör motparterna avsluta transaktionen för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "Fel" eftersom det överenskomna villkoret för transaktionen inte uppfylldes och transaktionen således aldrig kom till stånd.
94. Vidare bör det noteras att en tillfälligt utebliven avveckling som inte leder till avslutande av transaktionen för värdepappersfinansiering inte behöver rapporteras.

95. I det specifika fallet av marginalutlåning bör ingåendet av transaktionen för värdepappersfinansiering rapporteras vid första marknadsvärde för korta positioner eller nettodebetsaldo för kontanter (ur klientens synpunkt) och genomförandetillfället ifylls sedan i enlighet med detta.

4.9.2 Ändring och korrigeringsrapportering av en transaktion för värdepappersfinansiering

96. Ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering omfattar rapportering av följande åtgärdstyper: "Ändring" och "Rättelse". Rapporteringstiden är densamma som vid ingåendet av en transaktion, vilket innebär att en ändring blir rapporterbart från tidpunkten då den träder i kraft. I tillämpliga fall, t.ex. vid ändringar på lånesidan av utlåning eller inlåning av värdepapper, bör detta uppfattas som den avsedda avvecklingsdagen.
97. Motparterna bör endast rapportera de ändringar som har verkställts, dvs. inte ändringar som har överenskommits men träder i kraft i framtiden. Om motparterna till exempel kommer överens om ändring av räntan för en repa från ett visst datum som ligger i framtiden bör ändringen rapporteras endast när det överenskomna datumet (datumet för ikraftträdande av ändringen) infallit.
98. På liknande sätt som vid rapportering av ingåenden rapporteras inte tillfälligt uteblivna avvecklingar som sådana om de inte leder till ändring av transaktionen, vilka i så fall bör rapporteras med åtgärdstypen "Ändring". Om exempelvis delvis återlämnande av transaktionen för värdepappersfinansiering rapporterades som ändring och denna upphävs på grund av utebliven avveckling bör motparterna rapportera en annan ändring för denna transaktion för värdepappersfinansiering för att återställa ändringarna från det delvisa återlämnandet.
99. Vid retroaktiv ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering (t.ex. om motparterna i en transaktion för värdepappersfinansiering bilateralt kommer överens om ändring av räntan för en transaktion med ett införandedatum som redan infallit) förväntas inte motparterna lämna in nya rapporter för alla efterföljande aktiviteter från datumet för ikraftträdande av ändringen. Observera att korrekt händelsedatum i det förflutna bör anges i rapporten med retroaktiv ändring (detta ska motsvara datumet för ikraftträdande av ändringen). I detta fall bör transaktionsregister inte införa de ändrade uppgifterna i rapporten om transaktionsstatus⁴.
100. När det gäller korrigeringsrapportering bör felaktigt inlämnade uppgifter rapporteras så snart de upptäcks. En korrigeringsrapport behöver inte lämnas in om en motpart efter ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering endast har infört felaktiga uppgifter i sina egna interna system – i så fall behöver motparten i fråga bara sända ändringsrapporten med slutliga korrekta uppgifter.

4.9.3 Uppdateringar av säkerhet

101. Uppdatering av säkerhet bör rapporteras för datumet för dess ikraftträdande, dvs. den förväntade avvecklingsdagen. Vissa uppdateringar kan visserligen överenskommas

⁴ Se avsnitt 4.8.3 för närmare information om händelsedatumets effekt på transaktionsregisters hantering av rapporter.

mellan motparterna, men dessa riskerar att förbli ofullbordade av skäl som kan tillskrivas motparterna eller tredje parter (t.ex. centrala motparter eller centrala värdepapperscentraler). Detta skulle innebära att en viss rapport om uppdatering av säkerhet bör lämnas in på nytt med slutliga korrekta uppgifter. Tillfälligt uteblivna avvecklingar som inte påverkar den överenskomna säkerheten som ska ställas behöver inte rapporteras.

102. I vissa andra fall skulle motparterna redan ha kommit överens om vissa ändringar i säkerheten men ännu inte infört dessa. Motparterna bör endast rapportera de uppdateringar av säkerhet som har inträffat, vilket innebär att en säkerhet med förväntad avvecklingsdag i framtiden inte behöver rapporteras.
103. Uppdateringar av säkerhet är dagliga lägesrapporter som bör avspegla säkerhetens läge vid slutet av dagen. Intradagsändringar i säkerheten behöver inte rapporteras. I det specifika fallet med intradagsstransaktioner där säkerheten endast ställs på intradagsbasis och nollställs vid slutet av dagen bör motparterna rapportera säkerheten som noll.
104. Vid transaktioner på en handelsplats som clearas av en central motpart och som inkluderas i positionen samt rapporteras med åtgärdstypen "Positionskomponent", bör uppdateringar av säkerhet skickas för den position i vilka dessa transaktioner ingick i stället för de ursprungliga transaktionerna.
105. Slutligen bör det noteras att den sista uppdateringen av säkerhet förväntas gälla den sista dagen då den/de motsvarande transaktionen/transaktionerna för värdepappersfinansiering var utestående, och denna uppdatering bör lämnas in i slutet av påföljande dag. Efter det att en rapport med åtgärdstypen "Förtida avslut" har lämnats in för transaktionen/transaktionerna för värdepappersfinansiering, eller efter det att förfalldagen nåtts vid transaktionen/transaktionerna för värdepappersfinansiering med fast löptid, bör det inte lämnas in några uppdateringar av säkerhet för denna/dessa transaktion(er) för värdepappersfinansiering (utom vid uteblivna försenade rapporter).
106. I det specifika fall som gäller vid marginalutlåning bör uppdateringar av säkerhet endast skickas vid marknadsvärde på korta positioner eller nettodebetsaldo (ur klientens synpunkt). Om marginallånet ännu inte har utnyttjats av klienten rapporterar motparterna varken transaktion för värdepappersfinansiering eller motsvarande säkerhet. Det kan även finnas scenarier där marginallånet utnyttjades av klienten (och att transaktionen för marginalutlåning och motsvarande säkerhet därför rapporterades) men därefter har gått till noll. Om motparterna inte beslutar att avsluta transaktionen för värdepappersfinansiering bör motparterna i dessa fall lämna in en rapport med nollsäkerhet för den första dagen då marginallånet står på noll. När marginallånet används igen av klienten rapporteras de faktiska säkerhetsvärdena för denna transaktion för värdepappersfinansiering.

4.9.4 Uppdateringar av värdering, marginalsäkerhet och återanvändning

107. Vid uppdateringar av värdering bör motparterna skicka dagliga värderingar senast i slutet av den arbetsdag som följer efter värderingsdagen och ange detta datum i fältet "Händelsens datum".

108. Uppdateringar av marginalsäkerhet bör rapporteras när de träder i kraft, dvs. på den förväntade avvecklingsdagen, utan beaktande av tillfälligt utebliven avveckling.
109. I det specifika fall som gäller vid marginalsäkerheter som förbetalats till en central motpart avseende en portfölj av clearade transaktioner bör dessa rapporteras på T+1 för den första tillämpliga transaktionen för värdepappersfinansiering i portföljen i fråga (med hänvisning i form av en portföljkod) i stället för dagen efter dess inlämningsdag.
110. Rapporteringen av återanvändning är avvecklingsbaserad, vilket innebär att motparterna endast bör rapportera värdet på den återanvända säkerhet som avvecklats i slutet på en viss dag. Denna avvecklingsdag bör rapporteras som händelsens datum i återanvändningsrapporten, och rapporten bör lämnas in i slutet av påföljande dag (dvs. avvecklingsdagen +1). Återanvändningsrapporter är lägesrapporter per dagens slut. De bör med andra ord återge den återanvända säkerheten vid slutet av dagen snarare än att visa en ändring jämfört med tidigare rapporterade värden ("deltarapport").

4.9.5 Avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering

111. Motparterna bör inte skicka in en rapport med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut" om en transaktion för värdepappersfinansiering med fast löptid har löpt ut och därmed inte längre är utestående.
112. Om motparterna kommer överens om avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering med fast löptid före förfallodagen eller om avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering utan fastställd löptid bör de vidta någon av följande åtgärder:
 - a. Lämna in en rapport med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut" där den förväntade avvecklingen av avslutandet sker samma dag som avslutandet meddelades, eller
 - b. lämna in en rapport med åtgärdstypen "Ändring" där den förväntade avvecklingen av avslutandet sker dagen efter eller senare. I detta fall bör motparterna modifiera förfallodagen i enlighet med detta.
113. Rapporteringslogiken enligt de tekniska tillsynsstandarderna/genomförandestandarderna för förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering (och den gällande rapporteringslogiken enligt förordningen om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister) innebär att en avslutad transaktion inte kan "återöppnas". Detta medför att motparterna inte bör rapportera avslutandet om detta inte verkställs på grund av utebliven avveckling.
114. I praktiken gäller att om motparterna dagen efter den överenskomna dagen för förtida avslut upptäcker att avslutandet inte har avvecklats på den förväntade avvecklingsdagen, bör de inte skicka in en rapport med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut" förrän avslutandet är avvecklat. Om avslutandet upphävs till följd av utebliven avveckling bör motparten inte skicka in rapporten med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut" eftersom transaktionen för värdepappersfinansiering fortfarande är utestående.
115. På liknande sätt gäller vid transaktioner för värdepappersfinansiering som närmar sig förfallodagen (antingen den avtalsenliga [fält 2.14] eller den ändrade förfallodagen för rapportering av i förväg överenskommet förtida avslut) att om motparterna dagen efter

förfallodagen upptäcker att slutdelen av transaktionen för värdepappersfinansiering inte har avvecklats bör de skicka in en ändringsrapport för att ändra förfallodagen till nästa dag eller något annat datum i framtiden då avvecklingen förväntas. Det bör noteras att en sådan ändring av förfallodagen endast är möjlig fram till dagen efter förfallodagen; därefter är transaktionen för värdepappersfinansiering inte längre utestående och kan inte "återöppnas". Vid lyckad avveckling av återlämnandet bör motparterna inte skicka in kompletterande rapporter eftersom transaktionen för värdepappersfinansiering betraktas som ej utestående från och med dagen efter förfallodagen.

4.9.6 Översikt över rapporteringstidpunkter per rapport- och åtgärdstyp

116. Tabell 5 förtydligar vad som bör anges som "Händelsens datum" för varje rapport- och åtgärdstyp. Händelsens datum visar även per definition vad som ger upphov till rapporteringen, t.ex. den förväntade avvecklingsdagen vid säkerhetsuppdatering eller valuteringsdagen vid värderingsuppdatering. De faktiska rapporterna bör lämnas in i slutet av den arbetsdag som följer efter händelsens datum.

Tabell 5 – Händelsens datum		
Table	Action type	Händelsens datum
1&2	NEWT	Datomet för tecknandet av avtalet ("transaktionsdagen")
1&2	MODI	Datomet för ikraftträdandet av modifiering eller i förekommande fall förväntad avvecklingsdag
1&2	CORR	Datum från vilket korrigeringen ska gälla (oftast det datum för vilket de tidigare felaktiga uppgifterna hade rapporterats)
1&2	ETRM	Förväntad avvecklingsdag för avslutandet
1&2	EROR	NA
1&2	COLU	Förväntad avvecklingsdag
1&2	VALU	Valuteringsdag
3	NEWT	Förväntad avvecklingsdag
3	MARU	Förväntad avvecklingsdag
3	CORR	Datum från vilket korrigeringen ska gälla (oftast det datum för vilket de tidigare felaktiga uppgifterna hade rapporterats)
3	EROR	NA
4	NEWT	Verklig avvecklingsdag
4	REUU	Verklig avvecklingsdag
4	CORR	Datomet från vilket korrigeringen ska gälla (oftast det datum för vilket de tidigare felaktiga uppgifterna hade rapporterats)
4	EROR	NA

4.10 Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

117. Tabell 6 visar kartläggningen av företagshändelser under hela livscykeln av en transaktion för värdepappersfinansiering och de åtgärdstyper som definieras i de tekniska standarderna för rapportering.

118. Om motparterna kommer överens om förtida avslut och ersättning av en transaktion för värdepappersfinansiering bör detta rapporteras. I sådana fall bör motparterna först avsluta den ursprungliga transaktionen för värdepappersfinansiering (genom att skicka in antingen "Avslut/förtida avslut" eller "Ändring" med ändrad förfallodag) och sedan lämna in rapporten om den nya transaktionen (med åtgärdstypen "Ny").
119. På liknande sätt kartläggs alla händelser som leder till avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering efter åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut" för att förenkla tabellen, utom vid händelse 44 som specifikt rör rapportering av avslutanden. Det erkänns emellertid att om avslutandet av en transaktion har överenskommits för ett annat framtida datum bör det i allmänhet rapporteras som ändring av förfallodagen (med åtgärdstypen "Ändring") medan avslutande på samma dag bör rapporteras med åtgärdstypen "Avslut/förtida avslut".
120. Inga kompletterande åtgärdstyper kan anges i de tekniska standarderna för rapportering; de som anges i de tekniska standarderna bör användas av motparterna vid rapportering av transaktionen för värdepappersfinansiering och företagshändelserna med anknytning till dessa.
121. Livscykelhändelser för olika typer av transaktioner för värdepappersfinansiering bör rapporteras med följande åtgärdstyper (fält 2.98) och relevanta nivåer (fält 2.99)⁵.

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
1	Backloading	All	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN / PSTN	
2	Conclusion	All	Table 1 and Table 2	NEWT or POSC	TCTN / PSTN	<p>Detta inkluderar en agents blockvisa/sammanlagda/gruppvis a transaktioner för tilldelning till kunder.</p> <p>Detta inbegriper även eventuella transaktioner som kan rapporteras och som har ingåtts i avvecklingssyfte (automatisk kollateralisering av en internationell värdepapperscentral, andra kreditfaciliteter, automatisk intradagsinlåning av värdepapper från en internationell värdepapperscentral).</p> <p>Avvecklingen av den inledande delen, däribland fördröjd avveckling som inte leder till avslutande eller annan ändring av transaktionen för värdepappersfinansiering, bör inte rapporteras separat. Vid marginalutlåning rapporteras ingåendet av transaktionen när</p>

⁵ Förteckningen över företagshändelser är inte uttömmande.

⁶ Hänvisningarna avser tabellerna i de tekniska tillsynsstandarderna och de tekniska genomförandestandarderna för rapportering

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
						krediten beviljas för första gången.
3	Roll-over into new identical transaction	REPO	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN	
4	Extension	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Detta inkluderar t.ex. förlängning av en (förlängningsbar) repa, ad hoc-avtal för ändring av återköpsdatumet för en repa med fastställd löptid eller en överenskommelse om uppskjutande av återköpsdatumet som en del av problemhanteringsprocessen.
5	Automatic change of purchase and repurchase dates of an evergreen SFT at the end of each business day until termination or maturity	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	
6	Cancellation of disputed transaction (after external reporting)	All	Table 1 and Table 2	EROR	-	
7	New allocation of the SFTs	All	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN	T.ex. agentens meddelande om underliggande kapitalbelopp till en annan part vid en "sammanlagd" (pooled) agentrepa
8	Full reallocation with a new UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEWT	TCTN	Detta inkluderar även ett scenario där omfördelningen äger rum före avvecklingen av den inledande delen i den ursprungliga transaktionen.
9	Full reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + MODI	TCTN	Detta inkluderar även ett scenario där omfördelningen äger rum före avvecklingen av den inledande delen i den ursprungliga transaktionen.
10	Partial reallocation to a new UTI	All	Table 1 and Table 2	MODI + NEWT	TCTN	Detta inkluderar även ett scenario där omfördelningen äger rum före avvecklingen av den inledande delen i den ursprungliga transaktionen.

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
11	Partial reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	MODI + MODI	TCTN	Detta inkluderar även ett scenario där omfördelningen äger rum före avvecklingen av den inledande delen i den ursprungliga transaktionen.
12	Increase or reduce size of a repo by modifying the terms of the contract (same UTI, no settlement instructions issued)	REPO	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	
13	Agreement to accept the partial delivery of the collateral as final implemented by a change in contractual terms	REPO	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	
14	Partial termination	REPO, BSB, ML	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	
15	Partial return	All	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	Avvecklingen av delvis återlämnande, inklusive fördröjd avveckling som inte leder till annullering av delvis återlämnande, bör inte rapporteras separat.
16	Cancellation or failure of the partial return	SBL	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	En fördröjd avveckling som inte leder till annullering av delvis återlämnande bör inte rapporteras
17	Re-rating (fixed rate, spread or rebate rate)	REPO, BSB, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	
18	Agreed cancellation of the re-rate, hence reverting to the previous rate	REPO, BSB, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Om ändring av räntan inte har överenskommit utan rapporteras ensidigt av misstag bör ändringen till den tidigare räntesatsen rapporteras med "CORR".
19	Change in floating repo rate	REPO	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	
20	Scheduled change in rate on floating-rate collateral or index on index-linked collateral in a BSB	BSB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Denna händelse skulle leda till modifiering av återköpspriset i rapporten.
21	Events impacting the collateral value	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	COLU	-	T.ex. betalning av säkerhetsintäkter (repa, köp- och återförsäljningstransaktion), "manufactured payment" (repa, köp- och återförsäljningstransaktion), schemalagd ändring av räntesatsen för en säkerhet med

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
						rörlig ränta eller av indexet för en säkerhet med index vid valfri typ av repa
22	Cash mark	SBL	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	
23	Fee mark	SBL	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	
24	Valuation of securities on loan	SLB	Table 1 and Table 2	VALU	-	
25	Flat margin loan and/or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MODI	-	
26	Change in outstanding margin loan or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MODI	-	
27	Change of base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	MODI	-	
28	Additional base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	NEWT	-	Det finns en enda basvaluta per marginallån, därför bör tillkommande basvaluta rapporteras som ett nytt marginallån med en ny UTI-kod
29	Valuation of securities used as collateral	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
30	First allocation of collateral on the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	NEWT or COLU	TCTN	Åtgärdstypen NEWT används när uppgifter om säkerheter rapporteras tillsammans med andra uppgifter om transaktionen för värdepappersfinansiering i rapporten om en ny transaktion. Detta kan till exempel avse ett scenario där en säljare tilldelar en säkerhet för en ny repa med allmänt säkerhetsavtal eller trepartsagentens första tilldelning av säkerheter på transaktionsdagen
31	First allocation of collateral after the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	COLU	TCTN	Detta kan till exempel avse ett scenario där en säljare tilldelar en säkerhet för en ny repa med allmänt säkerhetsavtal eller trepartsagentens första tilldelning av säkerhet efter transaktionsdagen

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
32	Substitution of Collateral	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	Detta inkluderar t.ex. tillfällig ersättning av värdepapper med kontanter (oftast av en trepartsagent) vid brist på acceptabel säkerhet på säljarens konto, ersättning av tillfällig kontantsäkerhet med värdepapper som säkerhet, tillfällig kontantsäkerhet på fördröjt återlämnande av värdepapper som reaktion på infordring av tilläggsmarginälsäkerhet i enlighet med GMRA 6.h Detta inkluderar även eventuella ändringar i säkerheten till följd av företagshändelser
33	Change in collateral quality	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
34	Change in cash collateral amount or currency	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	COLU	-	
35	Buy-in where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
36	Cash compensation where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COLU	-	
37	Default of the collateral issuer	All	ALL	COLU or ETRM	TCTN / PSTN	ETRM bör endast anges om transaktionen för värdepappersfinansiering avslutas efter säkerhetsemitentens fallissemang. I annat fall bör ersättningen av säkerhet rapporteras med COLU
38	Variation margining	REPO, SLB, BSB	Table 1 and Table 2	COLU	-	Det är en separat COLU-rapport för nettoexponering
39	Change in haircut or margins	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	COLU	TCTN / PSTN	
40	Clearing off-venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEWT	TCTN / PSTN	Detta inkluderar OTC-transaktioner clearade samma dag eller senare
41	Post-trade clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEWT	TCTN / PSTN	Detta inkluderar transaktioner genomförda på en handelsplats och clearade efter transaktionsdagen

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
42	Same-day clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN / PSTN	Detta inkluderar transaktioner genomförda på en handelsplats samt clearade enligt en "open offer"-modell och med novation för samma dag
43	CCP rejects transaction which is conditional upon registration with the CCP	All	Table 1 and Table 2	EROR	-	
44	Termination of an open SFT or termination of a term repo (by agreement or unilaterally)	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI or ETRM	TCTN	ETRM bör anges vid avslutande samma dag, medan MODI bör användas för rapportering av ett avslutande på en dag som ligger i framtiden (genom ändring av förfallodagen).
45	Termination of an evergreen or puttable SFT	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Detta inkluderar eliminering av möjligheten till avslutande.
46	Maturity/Expiration	All	Table 1 and Table 2	no report	-	Tillfälligt utebliven avveckling av den utgående transaktionen för värdepappersfinansiering bör inte rapporteras separat
47	Full return of a term SLB prior to the maturity date or of an open term SLB	SBL	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Avvecklingen av det fullständiga återlämnandet (inklusive fördröjd avveckling som inte beror på upphävande av det fullständiga återlämnandet) bör inte rapporteras separat.
48	Cancellation or failure of the full return	SBL	Table 1 and Table 2	no report or NEWT	TCTN	Det fullständiga återlämnandet bör inte rapporteras om det inte avvecklas; därför förväntas ingen kompletterande rapport om det fullständiga återlämnandet upphävs. Om det fullständiga återlämnandet har angetts som ETRM och sedan upphävts bör transaktionen dock rapporteras på nytt med åtgärdstypen NEWT och en ny UTI-kod.
49	Closure of an SFT due to counterparty default	All	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Detta inkluderar t.ex. att motparten anses vara i fallissemang, förutsatt att detta fallissemang har överenskommit i enlighet med 10.a ii i GMRA.
50	Termination of transaction under specific GMRA provisions	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Detta omfattar: Avslutande av transaktionen i enlighet med bestämmelse 10.g i GMRA 2000 eller bestämmelse 10.h i GMRA 2011 "Mini-close-out" i enlighet med 10.h i GMRA 2000 eller 10.i i GMRA 2011 Räntejustering eller justering i

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
						enlighet med 4.i-k i GMRA 2000 eller 4.j-l i GMRA 2011
51	Terminating the relationship between prime broker and the client	ML	Table 1 and Table 2	ETRM	-	
52	Amend trade - bilateral	All	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN / PSTN	Motparterna kommer överens om ändring av ett transaktionsattribut. Detta är en övergripande händelse för eventuella modifieringar som inte listas separat.
53	Amend trade - unilateral	All	Table 1 and Table 2	CORR	TCTN / PSTN	En motpart korrigerar ett transaktionsattribut.
54	Amend collateral - bilateral	All	Table 1 and Table 2	COLU	TCTN / PSTN	Motparterna kommer överens om ändring av ett säkerhetsattribut. Detta är en övergripande händelse för eventuella modifieringar som inte listas separat.
55	Amend collateral - unilateral	All	Table 1 and Table 2	CORR	TCTN / PSTN	En motpart korrigerar ett säkerhetsattribut.
56	Lifecycle event (e.g. change in size or re-rating of open repo) incorrectly reported	All	Table 1 and Table 2	CORR	TCTN / PSTN	Ett felaktigt rapporterat förtida avslut eller fel kan inte korrigeras. Efter inlämnande av en rapport med dessa åtgärdstyper kan transaktionen inte återöppnas som "utestående", därför bör transaktionen rapporteras på nytt med åtgärdstypen NEWT och en ny UTI-kod.
57	Transaction not executed or out of scope of SFTR but reported to TR by mistake	All	Table 1 and Table 2	EROR	-	
58	Initial posting of margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	NEWT	-	
59	Update of the initial margin posted at the CCP	All	Table 3	MARU	-	
60	Posting variation margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	MARU	-	
61	Correction of a previous submitted margin report	All	Table 3	CORR	-	

Tabell 6 – Kartläggning av företagshändelser efter åtgärdstyp och nivå

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message ⁶	Action Type	Level	Kommentarer/exempel
62	Cancellation of a wrongly submitted margin report	All	Table 3	EROR	-	
63	First report of reuse of collateral or reinvestment of cash collateral	All	Table 4	NEWT	-	
64	Change in the securities reused or update of the estimated reuse or value of reused collateral	All	Table 4	REUU	-	
65	Change in cash collateral reinvestment type, amount or currency	SLB	Table 4	REUU	-	
66	Correction of a previously submitted collateral reuse report with incorrect data	All	Table 4	CORR	-	
67	Cancellation of a wrongly submitted collateral reuse report (e.g. for an entity not subject to the reporting obligation)	All	Table 4	EROR	-	

4.11 Identifiering av en deltagare i en central värdepapperscentral

122. Utom i fall där marginalutlåning rapporteras eller när en transaktion inbegriper råvaror bör motparterna alltid fylla i fältet för deltagare eller indirekt deltagare i en central värdepapperscentral. Fältet bör även fyllas i om transaktionen för värdepappersfinansiering avvecklas utanför en central värdepapperscentral. Esma förväntar sig att den rapporterande motparten fyller i detta fält med hjälp av följande logik:

- a. Rapporterar sin egen LEI-kod om avvecklingen sker direkt på en central värdepapperscentral, dvs. om motparten är deltagare i en central värdepapperscentral.
- b. Rapporterar sin egen LEI-kod om den avvecklar värdepapper på endera av de två internationella värdepapperscentralerna, även om den internationella värdepapperscentralen inte är emittentens centrala värdepapperscentral, dvs. om motparten är deltagare i en internationell värdepapperscentral.
- c. Rapporterar LEI-koden för sin depåbank oavsett om depåbanken använder en underdepåbank eller inte. Detta inkluderar scenarier där en motpart använder ett ombud för en långgivare.



123. Motparten bör inte ange LEI-koden för den centrala värdepapperscentral där den är direkt eller indirekt deltagare i fältet "Deltagare i en central värdepapperscentral".

4.12 Fastställande av motpartssida

4.12.1 Det allmänna fallet

124. Vid repor eller köp- och återförsäljningstransaktioner är köparen säkerhetstagare och säljaren är säkerhetsställare.
125. Vid utlåning eller inlåning av värdepapper eller transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror är långgivaren säkerhetstagare medan låntagaren är säkerhetsställare.
126. Vid marginallån är långgivaren säkerhetstagare medan låntagaren är säkerhetsställare.

4.12.2 Transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart

127. Vid transaktioner för värdepappersfinansiering som clearas av en central motpart står den centrala motparten emellan de två motparterna för transaktionen för värdepappersfinansiering. Den centrala motparten agerar således som köpare gentemot säljaren, som låntagare gentemot långgivaren, som säljare gentemot köparen och som långgivare gentemot låntagaren.

4.12.3 Rapportering av utlåning/inlåning av värdepapper utan säkerhet

128. Vid utlåning/inlåning av värdepapper utan säkerhet bör den motpart som lånar ut värdepappren ange sig själv som säkerhetstagare, medan den motpart som lånar värdepappren anger sig själv som säkerhetsställare i fält 1.9.

4.12.4 Rapportering av motpartssidan vid säkerhet på nettoexponeringsbasis

129. Vid säkerhet på nettoexponeringsbasis bör motparterna inte rapportera fälten "Motpartssida" för den säkerhet som används som tilläggsmarginalsäkerhet. Motparterna bör emellertid rapportera säkerheten som avser tilläggsmarginalsäkerhet i enlighet med avsnitt 5.4.7, med beaktande av om de fastställts vara nettosäkerhetsställare eller nettosäkerhetstagare.

4.13 Fält för pris och värde

4.13.1 Värderingstidpunkter

130. Vid clearing av en transaktion för värdepappersfinansiering bör information om värderingar från den centrala motparten användas för rapportering i enlighet med förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.

131. Värdepapprens marknadskurs bör vara den som gäller vid slutet av affärsdagen på varje bankdag och rapporteras senast på T+1 för att avspegla den värdering som används för säkerhetsförvaltning, t.ex. för beräkning av tilläggsmarginalsäkerhet på daglig basis.
132. Motparterna bör rapportera marknadskursen på sina transaktioner för värdepappersfinansiering med hjälp av de marknadspriser och växelkurser som motparterna har använt för säkerhetsförvaltning under respektive bankdag. Vid transaktioner för utlåning av värdepapper innebär detta i allmänhet att marknadskurser rapporterade per affärsdagens slut utgör slutkurserna på värdepappren per föregående bankdag och rapporteras senast på T+1.
133. Om värderingar för två olika dagar tillhandahålls bör motparterna fylla i fält 2.3 "Händelsens datum" för varje specifik dag.

4.13.2 Beräkningsmetod för värderingar

134. Vid rapportering enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering bör motparterna använda det värde som de använder för säkerhetsförvaltning och exponeringshantering.
135. Om ingen marknadskurs finns tillgänglig föreskriver förordningen ingen specifik metod för beräkning av dessa värderingar. Uppgifter som rapporteras i fält 2.57 och fält 2.88 kan ändå stämmas av och motparterna bör därför komma överens om och ange värden inom accepterade toleransgränser i enlighet med bilagan till de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter.
136. Marknadskursen för värdepappren bör rapporteras per affärsdagens slut varje arbetsdag och de avspeglar värderingen för säkerhetsförvaltning, t.ex. för beräkning av tilläggsmarginalsäkerheten på daglig basis.
137. Om marknadspriset på värdepapper som värderas inte finns tillgängligt bör den rapporterade motparten använda det senaste tillgängliga marknadspriset som reservalternativ.
138. Motparterna bör i förekommande fall använda XML-taggar för valuta i alla pridfält för korrekt identifiering av de relevanta fälten för värden och belopp, i synnerhet om de anges i någon annan valuta. Se även exemplet i avsnitt 5.2.1.8.
139. Om en växelkurs ska användas av en motpart för att ange en korrekt värdering bör Europeiska centralbankens kurs för valutatan användas. Om Europeiska centralbankens växelkurs saknas för omräkningen bör motparterna ömsesidigt komma överens om en växelkurs som ska användas för värdering och rapportering.

4.14 Rapportering av CFI-koden för ett värdepapper som används som säkerhet

140. Om ett värdepapper ställs som säkerhet bör värdepapprets CFI-kod anges i fält 42 och fält 79 i tabellen om uppgifter om lån och säkerhet. Detta fält används inte vid råvaror.
141. Motparterna bör alltid använda officiella källor för CFI-koden. Uppgifter utfärdade av den behöriga nationella numreringsmyndigheten bör användas i detta syfte. För närmare

information, se länken från ANNA, <http://www.anna-web.org/standards/about-identification-standards/>, eller vänd dig till den behöriga nationella numreringsmyndigheten för värdepappret.

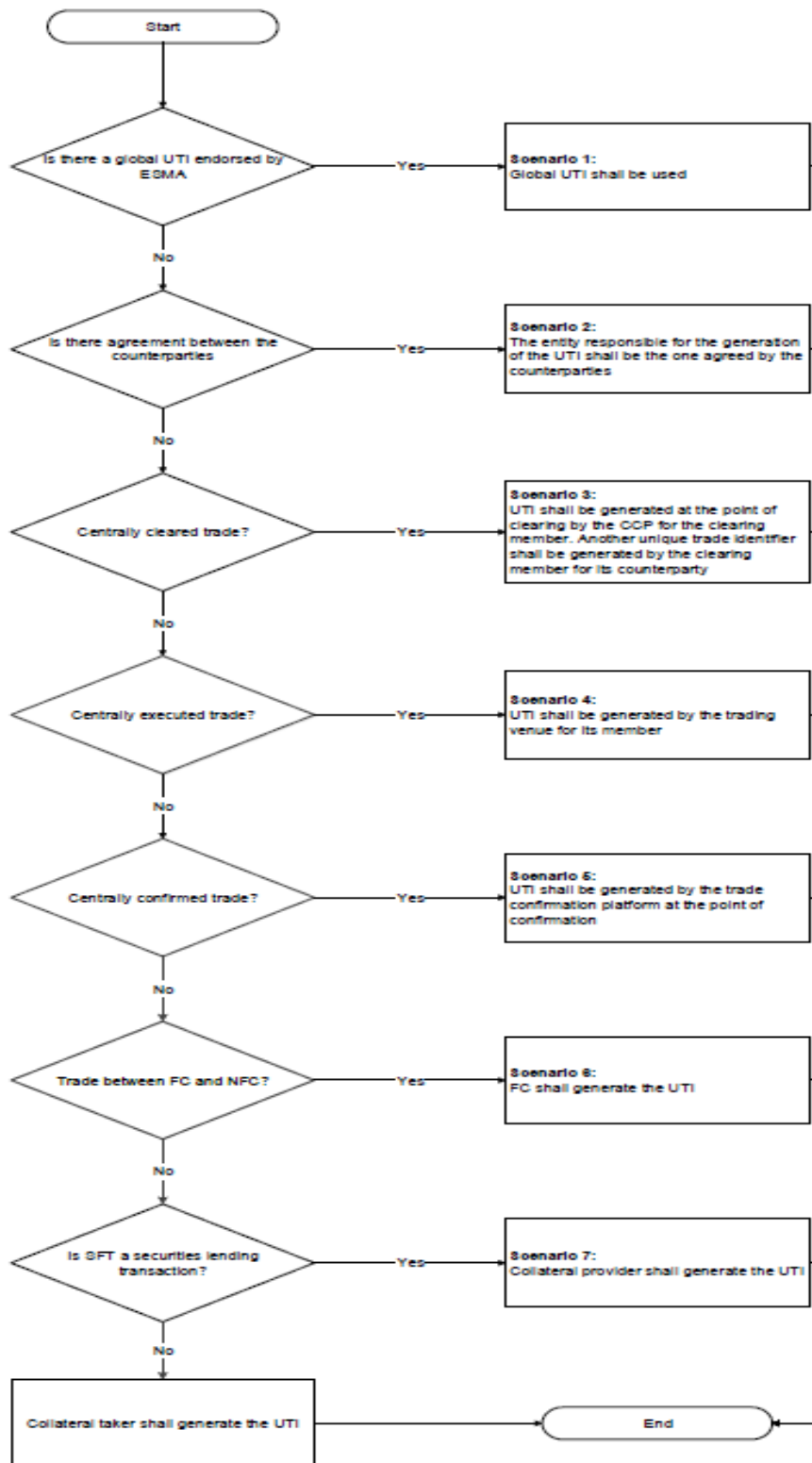
142. Endast giltiga CFI-koder bör rapporteras av motparterna. Om en viss CFI-kod saknas i de officiella källorna bör den överenskommas mellan motparterna eftersom CFI är ett avstämningsbart fält.

4.15 Senareläggning

143. Motparter som väljer att rapportera om ett tidigare startdatum för rapportering bör ange fullständiga och korrekta uppgifter om respektive senarelagda transaktioner, bland annat daglig uppdatering av säkerheten med åtgärdstypen "COLU". Om de rapporterar en del av sina transaktioner för värdepappersfinansiering bör de ange fullständiga och korrekta uppgifter om marginalsäkerhet och återanvändning i tabell 3 och tabell 4 i bilagan till de tekniska standarderna för rapportering.
144. Om båda motparterna omfattas av det aktuella startdatumet för rapportering bör de komma överens om vilken dag de ska senarelägga transaktionerna för värdepappersfinansiering till för att undvika avstämningsfel. Senarelagda transaktioner ska hur som helst ha rapporterats till startdatumet för rapportering +190. Om en rapporterande motpart vars startdatum för rapportering ännu inte har inträffat väljer att rapportera senarelagda transaktioner bör den säkra att varje transaktion för värdepappersfinansiering rapporteras i enlighet med avsnitt 146.
145. Om motparterna väljer att göra detta har de även möjlighet att frivilligt inkomma med fullständig rapportering av senarelagda transaktioner för värdepappersfinansiering (dvs. rapportering av alla transaktioner för värdepappersfinansiering som är öppna vid en viss tidpunkt efter det första startdatumet för rapportering före tidsgränsen enligt ovan).
146. Den senarelagda transaktionen bör rapporteras med åtgärdstypen "NEWT" (fält 2.98). Det ursprungliga genomförandetillfället bör anges i fältet för "Genomförandetillfälle" (fält 2.12). "Valuteringsdag (startdatum)" (fält 2.13) bör fyllas i med den ursprungliga valuteringsdagen om den inte har ändrats på grund av avvecklingsproblem med transaktionen för värdepappersfinansiering. Övriga datafält bör ange statusen vid rapporteringstidpunkten. De tidigare livscykelhändelserna bör inte rapporteras separat.

4.16 Generering och uppbyggnad av UTI-koder

147. Flödesschemat nedan illustrerar processen för generering av en UTI-kod.



148. Vid clearade transaktioner för värdepappersfinansiering bör varje transaktion för värdepappersfinansiering mellan den centrala motparten och dess clearingmedlemmar samt mellan clearingmedlemmarna och deras klienter rapporteras med olika UTI-koder.

149. Observera att överenskommelsen om UTI-kod mellan motparter i praktiken är reservalternativet enligt ramen i de tekniska standarderna eftersom de flesta enheter använder "vattenfallsmodellen" för generering av UTI-kod. Parterna kan ändå ha en sådan överenskommelse; i så fall bör de följa den vid alla fall som omfattas av överenskommelsen.
150. Vid transaktioner för värdepappersfinansiering utan fastställd löptid bör motparterna behålla de initialt genererade UTI-koderna för denna transaktion för värdepappersfinansiering i stället för att generera en ny vid varje förnyelse.
151. Den icke-genererande motparten bör kunna ta upp den UTI-kod som meddelas av den genererande motparten i sina system eller den rapporteringsansvariga enhetens eller den rapportinlämnande enhetens system.
152. Motparterna bör införa de nödvändiga tekniska arrangemangen för den utbytta datavolymen för att säkra kommunikation i tid och upptagning av UTI. Vid problem med generering eller meddelande av UTI-kod bör motparterna i god tid säkerställa en lösning och lämna in rapporter inom tidsfristen för rapportering av transaktionen för värdepappersfinansiering.
153. Om själva UTI-koden är felaktig bör transaktionen annulleras och rapporteras som ny med korrekt UTI-kod.
154. Vad gäller formatet för UTI-kod kan motparterna i en transaktion för värdepappersfinansiering överväga användning av CPMI-IOSCO:s vägledning som rekommenderar att strukturera nya UTI-koder som en sammanlänkad kombination av:
 - a. den genererande enhetens giltiga LEI-kod vid genereringstidpunkten och
 - b. ett unikt värde genererat av enheten (värdet behöver endast vara unikt inom uppsättningen av värden genererade av denna enhet eftersom kombinationen med LEI-koden gör den globalt unik).

4.17 Identifiering och rapportering av förmånstagare

155. Ett vanligt fall (även om det kan finnas andra) inkluderar paraply- och delfondsstrukturer där paraplyfonden är motparten och delfonden eller delfonderna är förmånstagare.
156. Det kan även förekomma fall där förmånstagaren är en avskild grupp; i så fall bör LEI-koden användas för identifiering av en sådan avskild grupp⁷.

4.18 Identifiering av värdepapper och emittent av värdepapper

157. Motparter bör ange LEI-koden för emittenten/emittenterna av utlånade eller inlånade värdepapper, LEI-koden för emittenten/emittenterna av värdepapper använda som säkerhet och ISIN-koderna för värdepappren.

⁷ Som det anges i rekommendation 8 i 2012 års rapport "En global identifieringskod för juridiska personer på finansmarknader" från rådet för finansiell stabilitet (FSB), kan grupper av tillgångar eller andra avskilda delar av en juridisk enhet ha separata rättigheter och skyldigheter på en tillräcklig nivå av oberoende i förhållande till denna juridiska enhet och således vara berättigad till en egen LEI-kod. Detta stämmer även överens med ISO-standard 17442:2012 för identifieringskoder för juridiska personer.

158. Vid rapportering av dessa uppgifter bör motparterna tillse att ISIN-koden och emittentens LEI-kod stämmer överens med varandra och att rapporteringen sker i enlighet med valideringsreglerna.

4.19 Procedur om en av motparterna genomgår en företagshändelse

159. Enheten med den nya LEI-koden (t.ex. en sammanslagen eller förvärvande enhet – nedan kallad "ny enhet") bör underrätta det/de transaktionsregister där den rapporterade sina transaktioner för värdepappersfinansiering om ändringen och begära uppdatering av beteckningen i de utestående transaktionerna för värdepappersfinansiering enligt avsnittet 162 nedan. Om ändringen av beteckningen beror på sammanslagning eller förvärv bör den sammanslagna eller förvärvande enheten även korrekt uppdatera LEI-koden för den förvärvade/sammanslagna enheten. I förekommande fall bör motparten även ange uppgifter om byte av land.
160. Vid omstruktureringar av företag som påverkar alla utestående transaktioner för värdepappersfinansiering bör transaktionsregistret identifiera alla utestående transaktioner för värdepappersfinansiering där enheten identifieras med den gamla LEI-koden i något av fälten "ID för rapporterande motpart" eller "ID för den andra motparten" och ersätta den gamla LEI-koden med den nya.
161. Andra omstruktureringar av företag, inbegripet men inte begränsat till delförvärv och avknopningsföretag, kan endast påverka en undergrupp av utestående transaktioner för värdepappersfinansiering; i så fall bör den nya enheten korrekt lämna in UTI-koderna för de transaktioner för värdepappersfinansiering som påverkas av händelsen till transaktionsregistret.
162. Följande kontrollerade process används för detta:

- a. Den nya enheten bör lämna in skriftlig dokumentation till den/de transaktionsregister där den rapporterade sina transaktioner för värdepappersfinansiering och begära ändring av LEI-koden med hänvisning till en företagshändelse. I dokumentationen bör följande uppgifter anges tydligt: i) LEI-koden eller -koderna för de enheter som deltar i sammanslagningen, förvärvet eller annan företagshändelse, ii) LEI-koden för den nya enheten, iii) datumet för ändringen och iv) UTI-koderna för de ifrågakvarande utestående transaktionerna för värdepappersfinansiering.

Vid sammanslagning eller förvärv bör dokumentationen inkludera bevis eller intyg på att företagshändelsen har ägt rum eller ska äga rum och vara tillbörligt undertecknad. Enheten bör i den mån det är möjligt tillhandahålla den erforderliga informationen i förväg så att ändringarna inte införs i efterhand utan per datumet angivet i "iii". Observera att underlåtenhet att uppdatera den nya LEI-koden i tid ska leda till avvisande av rapporter inlämnade av enheten om den tidigare har identifierats med den gamla LEI-koden med motsvarande status (dvs. "Emitterad", "I avvaktan på överföring" eller "I avvaktan på arkivering") och denna status sedan har ändrats till "Sammanslagen".

- b. Transaktionsregistret bör meddela denna information till alla andra transaktionsregister via en särskild fil som inkluderar i) den/de gamla LEI-koden/-koderna, ii) den/de nya LEI-koden/-koderna och iii) det datum då ändringen ska

införas. Filen bör i den mån det är möjligt skickas ut i förväg så att ändringen inte införs i efterhand utan på det datum som anges i "iii".

- c. Varje motpart för transaktionerna för värdepappersfinansiering som avser någon av de sammanslagna identifierade enheterna bör underrättas om ändringen av det transaktionsregister till vilket de rapporterar.
 - d. Transaktionsregistret/-registren bör även underrätta de tillsynsmyndigheter som har tillgång till uppgifterna om de transaktioner för värdepappersfinansiering som har blivit uppdaterade.
 - e. I förekommande fall bör transaktionsregistret uppdatera fält 1.12 "Den andra motpartens land".
 - f. Ändringarna bör lagras i den rapporteringslogg som förvaltas av varje transaktionsregister.
163. Påföljande rapporter bör valideras mot GLEIF (Global LEI Foundation) som vanligt och aviseras om valideringen inte klaras.
164. Det förväntas således inte att en enhet lämnar in en rapport på grund av en ny LEI-kod.
165. Proceduren enligt ovan bör inte följas om motparter identifierar sig felaktigt. I så fall bör de lämna in en rapport om transaktion för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "EROR", komma överens om en ny UTI-kod med den andra motparten och rapportera fullständiga och korrekta uppgifter för transaktionen för värdepappersfinansiering.

4.20 Rapportering under övergångsperioden

166. De motparter vars rapporteringsskyldighet ännu inte har börjat bör förse den motpart vars rapporteringsskyldighet har börjat med alla relevanta uppgifter i enlighet med de tekniska standarderna för rapportering. Den information som bör tillhandahållas den rapporterande motparten består av två datafält. Dessa datafält är "Den andra motparten", "Filial till den rapporterande motparten" och "Den andra motpartens land". Informationen för dessa datafält bör tillhandahållas den rapporterande motparten i tid.
167. Om de motparter som ännu inte är rapporteringsskyldiga anser att det är enklare kan de börja rapportera före det relevanta startdatumet för rapportering enligt artikel 33.2 a i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering. Om en motpart som ännu inte är rapporteringsskyldig väljer att rapportera transaktioner bör denna part följa punkt 144 i avsnitt 4.15 i riktlinjerna.

5 Tabeller om fält enligt förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering

168. I artikel 1.1 i de tekniska tillsynsstandarderna för rapportering föreskrivs att "Rapporter enligt artikel 4.1 i förordning (EU) 2015/2365 ska innehålla fullständiga och korrekta uppgifter enligt vad som anges i tabellerna 1, 2, 3 och 4 i bilagan, för den berörda transaktionen för värdepappersfinansiering". Användningsfallen enligt avsnitt 5.1 till 5.6 inkluderar inte nödvändigtvis alla fält som gäller för den berörda transaktionen för

värdepappersfinansiering. De fokuserar i stället på vissa grupper av datafält för att ge en mer ingående och detaljerad vägledning om rapporteringen utan onödig upprepning eller angivelse av andra dataelement.

169. Valideringsreglerna utgör en fullständig vägledning om de fält som är tillämpliga per typ av transaktion för värdepappersfinansiering, åtgärdstyp och nivå samt de relevanta beroendeförhållandena.
170. I följande avsnitt presenteras olika scenarier med tillhörande tabeller som förklarar hur dessa scenarier bör rapporteras. Varje tabell visar rapporteringsfälten enligt de tekniska standarderna i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering. I kolumnen "Fält" visas fältens namn och i kolumnen "Exempel" ges exempel på vad som bör ingå i respektive fält. I den sista kolumnen, som har rubriken "XML-meddelande", visas formatet för det XML-meddelande som ska lämnas in i transaktionsrapporten.
171. Om inget annat anges i det berörda scenariot är följande bakgrundsinformation tillämplig på alla scenarier som tas upp i del 5:

Motpart A är en finansiell motpart som identifieras med LEI-kod 12345678901234500000
Motpart B är en fransk finansiell motpart som identifieras med LEI-kod ABCDEFGHIJKLMNOPQRST
Motpart C är ett icke-finansiellt SMF-företag som identifieras med LEI-kod 123456789ABCDEFGHIJK
Motpart D identifieras med LEI-kod 11223344556677889900
Mäklare E identifieras med LEI-kod 88888888888888888888
Ombud för långgivare F identifieras med LEI-kod BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB
Trepartsagent G identifieras med LEI-kod 77777777777777777777
Depåbank H identifieras med LEI-kod AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA
Tredje part I tillhandahåller rapporteringstjänster och identifieras med LEI-kod 12345123451234512345
Motpart J agerar även som clearingmedlem och identifieras med LEI-kod CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC
Fondföretagets fond K identifieras med LEI-kod UUUUUUUUUU1111111111 medan fondföretagets förvaltningsbolag identifieras med LEI-kod UUUUUUUUUU2222222222
Alternativ investeringsfond M identifieras med LEI-kod AAAAAAAAAA1111111111 medan den alternativa investeringsfondens förvaltningsbolag N identifieras med LEI-kod AAAAAAAAAA2222222222
Central motpart O identifieras med LEI-kod BBBBBBBBBB1111111111

Den tyska emittenten av värdepapper identifieras med LEI-kod NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN

Den spanska emittenten av värdepapper identifieras med LEI-kod EEEEEEEEEEEEEEEEEEEEE

Den franska emittenten av värdepapper identifieras med LEI-kod FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF

Den holländska emittenten av värdepapper identifieras med LEI-kod DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD

Den italienska emittenten av värdepapper identifieras med LEI-kod IIIIIIIIIIIIIIIIIIIII

En allmän emittent av värdepapper identifieras med GGGGGGGGGGGGGGGGGGGGG

Den franska emittenten av aktier som ingår i ett centralt index identifieras med LEI-kod 529900S21EQ1BO4ESM68

Handelsplats P identifieras med MIC XWAR

Värdepapper identifieras med följande ISIN-koder:

- a. Tyska obligationer ("vanilla"): DE0010877643
- b. Spanska eviga obligationer: ES0010877643
- c. Franska obligationer: FR0010877643
- d. Holländska obligationer: NL0010877643
- e. Franska aktier som ingår i ett centralt index: FR0000120271
- f. Andra franska värdepapper: FR0010877000
- g. Korg av säkerheter: GB00BH4HKS39
- h. Säkerhetskomponent 1: IT00BH4HKS39
- i. Säkerhetskomponent 2: FR00BH4HKS39

Värdepapper klassificeras med följande CFI-koder:

- a. Statsobligation ("vanilla"): DBFTFR
- b. Evig statsobligation: DBFTPR
- c. Aktier: ESVUFN

De tomma gråskuggade fälten i dessa tabeller används inte i dessa specifika exempel utan visas i förklarande syfte.

Användningsfallens tillämplighet för olika typer av transaktioner för värdepappersfinansiering anges. Vidare anges den faktiska rapporteringen i enlighet med de XML-scheman som följer standarden ISO 20022.

5.1 Uppgifter om motparter

172. Vid clearing av en transaktion för värdepappersfinansiering bör varje motpart ange sin clearingmedlem i fältet för clearingmedlem.
173. Vid frivillig delegering av rapportering eller tilldelning av ansvar bör den rapportinlämnande enheten eller den enhet som ansvarar för rapportering ange uppgifter om motparterna separat och uppgifter om lån och säkerhet anges för vardera sida.
174. Vid användningsfall som omfattar två eller fler av de nedan angivna användningsfallen bör de rapporterade enheterna eller de rapporteringsansvariga enheterna ange alla relevanta uppgifter i enlighet med vägledningen nedan.

Tabell 7 – Användningsfall				
	Repo and reverse repo	BSB / SBB	Securities and commodities lending	Margin lending
Non-cleared bilateral SFT between headquarters	Y	Y	Y	Y
Non-cleared bilateral SFT between branches	Y	Y	Y	Y
Non-cleared bilateral SFT with beneficiaries	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFT with brokers, settled with a custodian bank	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFT with broker, agent lender and tri-party agent	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFT with broker, agent lender and tri-party agent, settled with a CSD participant different from any of the entities and voluntary delegation of reporting to a third party	Y	Y	Y	N
Cleared SFT with broker, agent lender, tri-party agent	Y	Y	Y	N

Tabell 7 – Användningsfall

	Repo and reverse repo	BSB / SBB	Securities and commodities lending	Margin lending
Cleared SFT with broker, agent lender, tri-party agent settled with a CSD participant different from any of the entities and voluntary delegation of reporting to a third party	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund	Y	Y	Y	Y
Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITS management company delegates reporting to a third party	Y	Y	Y	Y
Non-cleared SFTs concluded by AIF	Y	Y	Y	Y
Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced	Y	Y	Y	Y

5.1.1 Ej clearade bilaterala transaktioner för värdepappersfinansiering mellan huvudkontor

175. Tabell 8 visar vilka typer av transaktioner för värdepappersfinansiering som kan ingås rent bilateralt mellan två huvudkontor.

Tabell 8 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

176. Tabell 9 illustrerar rapporteringen av en bilateral transaktion där den rapporterade motparten (motpart A) även lämnar in sina rapporter (det finns med andra ord ingen separat rapporterad enhet). Motpart A är även förmånstagaren för denna transaktion och deltagaren i en central värdepapperscentral.

Tabell 9 – Ej clearade bilaterala transaktioner för värdepappersfinansiering mellan huvudkontor			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2021-02-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>1234567890123450000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other Counterparty	FR	
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		
15	Broker		
16	Clearing member		

Tabell 9 – Ej clearade bilaterala transaktioner för värdepappersfinansiering mellan huvudkontor

No	Field	Example	XML Message
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<pre> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
18	Agent lender		

5.1.2 Ej clearade bilaterala transaktioner för värdepappersfinansiering mellan filialer

Tabell 10 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

177. Tabell 11 visar ett exempel på rapportering av en bilateral transaktion som ingås mellan filialer tillhörande två motparter. De juridiska enheterna (huvudkontor) identifieras med respektive LEI-kod medan länderna för filialerna identifieras med ISO-landskoder. Motpart A är även deltagaren i en central värdepapperscentral.

Tabell 11 – Ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering mellan filialer

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> </pre>

Tabell 11 – Ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering mellan filialer

No	Field	Example	XML Message
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty	FR	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
8	Branch of the other counterparty	DE	<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clsfctn>CDTI</Clsfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Ntr> <Brnch> <Ctry>FR</Ctry>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</Brnch> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
12	Country of the other Counterparty	FR	<OthrCtrPty> <Id>
13	Beneficiary		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
14	Tri-party agent		<Brnch>
15	Broker		<Ctry>DE</Ctry>
16	Clearing member		</Brnch> <CtryCd>FR</CtryCd>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
18	Agent lender		<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <StlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
			<LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </StlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>

Tabell 11 – Ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering mellan filialer			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.3 Ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering med förmånstagare

Tabell 12 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet				
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending	
Y	Y	Y	N	

178. Tabell 13 visar ett exempel på en bilateral ej clearad transaktion där motpart A inte är förmånstagaren för transaktionen. Förmånstagaren är motpart D. Motpart A är även deltagaren i en central värdepapperscentral.

Tabell 13 – Ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering med förmånstagare			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	

Tabell 13 – Ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering med förmånstagare

No	Field	Example	XML Message
6	Additional sector classification		<Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI>
8	Branch of the other counterparty		</Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
9	Counterparty side	GIVE	</FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other Counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary	{LEI} of counterparty D	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
14	Tri-party agent		<LEI>12345678901234500000</LEI>
15	Broker		</NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData> <Bnfcry>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<LEI>11223344556677889900</LEI> </Bnfcry> <SttlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.1.4 Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, avvecklad med en depåbank

Tabell 14 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

179. I det scenario som illustreras i Tabell 15 ingår motpart A en transaktion med motpart B. Motpart A använde depåbank H som följaktligen anges i fält 1.17. Dessutom använder motpart A tjänster av mäklare E.

Tabell 15 – Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, avvecklad med en depåbank			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> </CtrPtyData> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other Counterparty	FR	

Tabell 15 – Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, avvecklad med en depåbank			
No	Field	Example	XML Message
13	Beneficiary		<CtryCd>FR</CtryCd>
14	Tri-party agent		</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>1234567890123450000</LEI>
16	Clearing member		</NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI>
18	Agent lender		</Brkr> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

5.1.5 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för en långivare och trepartsagent

Tabell 16 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

180. I det scenario som illustreras i Tabell 17 ingår motpart A en transaktion med motpart B. Motpart A använder ombud för långgivare F och trepartsagent G. Dessutom använder motpart A tjänster av mäklare E. Motpart A är deltagaren i en central värdepapperscentral.

Tabell 17 – Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	...
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	<CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		<LEI>12345678901234500000</LEI>
7	Branch of the reporting counterparty		</Id> <Ntr>
8	Branch of the other counterparty		<FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
9	Counterparty side	GIVE	</FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<OthrPtyData> <TrptyAgt>
16	Clearing member		<LEI>77777777777777777777777777777777</LEI>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	</TrptyAgt> <Brkr> <LEI>88888888888888888888888888888888</LEI>

Tabell 17 – Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent

No	Field	Example	XML Message
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<pre> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>1234567890123450000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.6 Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent, avvecklad med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part.

Tabell 18 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

181. I det scenario som illustreras i Tabell 19 ingår motpart A en transaktion med motpart B. Motpart A använder ombud för långgivare F och trepartsagent G. Dessutom använder motpart A tjänster av mäklare E och depåbank H. Motpart A delegerar slutligen rapporteringen till tredje part I.

Tabell 19 – Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långivare och trepartsagent, avvecklad med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty>
6	Additional sector classification		<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI>
8	Branch of the other counterparty		</Id> <Ntr>
9	Counterparty side	GIVE	<FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
13	Beneficiary		<CtryCd>FR</CtryCd>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of Broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<TrptyAgt> <LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI>

Tabell 19 – Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent, avvecklad med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB </LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.7 Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent

Tabell 20 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

182. Tabell 21 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid en clearad transaktion för värdepappersfinansiering. Fälten fylls i på samma sätt oberoende av typen av åtkomst som motparten har till en central motpart. Den bör alltid ange den enhet som agerar som clearingmedlem.

183. Motpart A har åtkomst till den centrala motparten via en clearingmedlem. Den använder även tjänster av mäklare E, ombud för långgivare F och trepartsagent G. Motpart A är även deltagaren i en central värdepapperscentral.
184. Observera att fältet för central motpart avser tabell 2 (Uppgifter om lån och säkerhet) och ifyllandet beskrivs därför i avsnitt 5.2.

Tabell 21 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData>
6	Additional sector classification		<RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
8	Branch of the other counterparty		<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Ntr> <Sd>GIVE</Sd>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<TrptyAgt> <LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt>

Tabell 21 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent

No	Field	Example	XML Message
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<pre> <Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </ClrMmb> <StlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234512345</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </StlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB </LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.8 Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part

Tabell 22 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

185. På liknande sätt som i det föregående exemplet illustrerar Tabell 23 ifyllandet av rapporteringsfälten vid en clearad transaktion för värdepappersfinansiering och motpart A med åtkomst till den centrala motparten via clearingmedlem J. Motpart A anlitar även tjänster av mäklare E, ombud för långgivare F och trepartsagent G. I detta exempel avvecklas transaktionen dessutom med enhet H, som inte är någon av motparterna, och den rapporterade motparten delegerar rapporteringen till en tredje part.

186. Observera att fälten fylls i på samma sätt oberoende av motpartens typ av åtkomst till den centrala motparten. Motparten bör alltid ange den enhet som agerar som clearingmedlem.

Tabell 23 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långgivare och trepartsagent, avvecklad med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty>
6	Additional sector classification		<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI>
8	Branch of the other counterparty		</Id> <Ntr>

Tabell 23 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långivare och trepartsagent, avvecklad med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part

No	Field	Example	XML Message
9	Counterparty side	GIVE	<FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
12	Country of the other counterparty	FR	<Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id>
13	Beneficiary		<CtryCd>FR</CtryCd>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<OthrPtyData> <TrptyAgt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </ClrMmb> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData>

Tabell 23 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering med mäklare, ombud för långivare och trepartsagent, avvecklad med en deltagare i en central värdepapperscentral som inte är någon av enheterna och med frivillig delegering av rapporteringen till en tredje part

No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.9 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av ett fondföretag

Tabell 24 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

187. Tabell 25 visar rapporteringen av en transaktion för värdepappersfinansiering som har ingåtts av fondföretag K. I enlighet med artikel 4.3 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering ansvarar fondföretagets förvaltningsbolag L för rapportering för fondföretagets räkning; därför bör både fältet 2.2 "Rapporterande enhet" och 2.10 "Enhet som ansvarar för rapportering" fyllas i. Transaktionen avvecklas med depåbank H.

Tabell 25 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av ett fondföretag

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of UCITS management company L	
3	Reporting counterparty	{LEI} of UCITS K	

Tabell 25 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingår av ett fondföretag

No	Field	Example	XML Message
4	Nature of the reporting counterparty	F	<pre> <LEI>UUUUUUUUUUU2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>UUUUUUUUUUU1111111111</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>UUUUUUUUUUU2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
5	Sector of the reporting counterparty	UCIT	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other counterparty	FR	
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	
18	Agent lender		

5.1.10 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av ett fondföretag varvid fondföretagets förvaltningsbolag delegerar rapporteringen till en tredje part

Tabell 26 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

188. Tabell 27 visar rapporteringen av en transaktion för värdepappersfinansiering ingången av fondföretag K. I enlighet med artikel 4.3 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering ansvarar fondföretagets förvaltningsbolag L för rapportering för fondföretagets räkning; därför bör det anges i fält 2.10 "Enhet som ansvarar för rapportering". Det beslutar dock att delegera rapporteringen till tredje part I, som därför anges i fält 2.2 "Rapporterande enhet". Transaktionen avvecklas med depåbank H.

Tabell 27 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av en fond av ett fondföretag			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>UUUUUUUUUUU1111111111</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	
3	Reporting counterparty	{LEI} of UCITS K	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	UCIT	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	

Tabell 27 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av en fond av ett fondföretag			
No	Field	Example	XML Message
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
13	Beneficiary		<CtryCd>FR</CtryCd>
14	Tri-party agent		</OthrCtrPty>
15	Broker		<NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.1.11 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingås av en alternativ investeringsfond

Tabell 28 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

189. Tabell 29 visar rapportering av en transaktion för värdepappersfinansiering som ingår av den alternativa investeringsfonden M. I enlighet med artikel 4.3 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering ansvarar den alternativa investeringsfondens förvaltningsbolag B för rapportering för den alternativa investeringsfondens räkning; därför anges det både i fält 2.2 "Rapporterande enhet" och 2.10 "Enhet som ansvarar för rapportering". Transaktionen avvecklas med depåbank H.

Tabell 29 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingår av en alternativ investeringsfond (AIF)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of AIF management company N	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of AIF M	... <CtrPtyData>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	AIFD	<LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty>
6	Additional sector classification		<CtrPtyData> <RptgCtrPty>
7	Branch of the reporting counterparty		<Id>
8	Branch of the other counterparty		<LEI>AAAAAAAAAA1111111111</LEI> </Id>
9	Counterparty side	GIVE	<Ntr> <FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of AIF management company N	<Clssfctn>AIFD</Clssfctn> </FI>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</Ntr> <Sd>GIVE</Sd>
12	Country of the other counterparty	FR	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
13	Beneficiary		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
14	Tri-party agent		<CtryCd>FR</CtryCd>
15	Broker		</OthrCtrPty>
16	Clearing member		<NttyRspnsblForRpt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt>

Tabell 29 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som ingår av en alternativ investeringsfond (AIF)

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </SttImPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.1.12 Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering där förvaltning av fondens portfölj har getts i uppdrag

190. Om förvaltning av fondens portfölj har getts i uppdrag till någon annan enhet än fondförvaltningsföretaget bör denna enhet endast anges som mäklare om den agerar som sådan. I annat fall anges denna enhet inte i något fält, på samma sätt som andra enheter som eventuellt direkt eller indirekt deltar i transaktionen för värdepappersfinansiering.
191. I det scenario som illustreras i Tabell 31 delegeras förvaltningen av portföljen för den alternativa investeringsfonden M till en annan enhet som inte agerar som mäklare. Transaktionen avvecklas med depåbank H.

Tabell 30 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av användningsfallet

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

Tabell 31 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering där förvaltning av fondens portfölj har getts i uppdrag

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> </pre>

Tabell 31 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering där förvaltning av fondens portfölj har getts i uppdrag

No	Field	Example	XML Message
2	Report submitting entity	{LEI} of AIF management company N	<New> ...
3	Reporting counterparty	{LEI} of AIF M	<CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	AIFD	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>AAAAAAAAAA1111111111</LEI> </Id>
8	Branch of the other counterparty		<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clssfctn>AIFD</Clssfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of AIF management company N	</Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty>
14	Tri-party agent		<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of AIF management company N	<LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData> <Brkr> <LEI>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </Brkr>
18	Agent lender		<SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ...

Tabell 31 – Ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering där förvaltning av fondens portfölj har getts i uppdrag

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2 Uppgifter om lån och säkerhet

192. Efter ifyllandet av fälten för uppgifter om motparter bör fälten för lån och säkerhet i olika användningsfall fyllas i. Även rapportering i enlighet med XML-scheman enligt ISO 20002 anges. Detta underlättar för motparterna att fylla i fälten.
193. Varje underavsnitt innehåller en kort beskrivning över rapporteringslogiken för fälten i fråga.

5.2.1 Rapportering av åtgärdstyper på transaktionsnivå och positionsnivå.

5.2.1.1 Ny ej clearad bilateral transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå

194. Tabell 32 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid en ny transaktion för värdepappersfinansiering som inte är clearad. Bilaterala transaktioner för värdepappersfinansiering bör rapporteras på följande sätt på transaktionsnivå.

Tabell 32 – Ny ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <ClrSts> </pre>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

Tabell 32 – Ny ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <NonClrd>NORE</NonClrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.2 Ny bilateral transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå som i) har clearats samma dag eller som ii) clearats senare.

195. Tabell 33, Tabell 34 och Tabell 35 illustrerar hur en motpart (inte den centrala motparten) bör fylla i rapporteringsfälten om en ny transaktion för värdepappersfinansiering har i) genomförts bilateralt och clearats senare under samma dag eller ii) har clearats en påföljande dag efter dess ingående på handelsplatsen. Motparterna bör lämna in en rapport om transaktion för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "ETRM", som utesluter ifyllande av fältet "Clearad" för att ange förtida avslut av transaktionen som har rapporterats som ej clearad. Efteråt bör motparten lämna in en rapport om transaktion för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "NEWT" för att visa att transaktionen för värdepappersfinansiering har clearats. Ordningsföljden för inlämnande av rapporter illustreras av Tabell 33, Tabell 34 respektive Tabell 35.

Tabell 33 – Ny bilateral transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå, clearad samma dag eller senare.			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </RpTrad> <ClrSts> <NonClrd>NORE</NonClrd> </pre>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

Tabell 33 – Ny bilateral transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå, clearad samma dag eller senare.

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </ClrSts> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

Tabell 34 – Avslutande av en bilateral transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå på grund av clearing samma dag eller senare.

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <EarlyTermntn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </EarlyTermntn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
98	Action type	ETRM	
99	Level		

Tabell 35 – Ny clearad transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå till följd av clearing av en bilateral transaktion för värdepappersfinansiering samma dag eller senare.

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT12	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> </pre>
2	Report tracking number	UT11 ⁸	

⁸ Sett ur clearingmedlemmens klients synvinkel, gäller ej för den centrala motpartens rapport.

Tabell 35 – Ny clearad transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå till följd av clearing av en bilateral transaktion för värdepappersfinansiering samma dag eller senare.

No	Field	Example	XML Message
5	Cleared	true	<CtrPtyData> ...
98	Action type	NEWT	</CtrPtyData> ...
99	Level	TCTN	<LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

196. Observera att rapporter enligt Tabell 33 och Tabell 34 inte förväntas om transaktionen ingås på en handelsplats av motparter som även agerar som clearingmedlemmar och clearas av en central motpart samma dag; i detta fall bör endast rapport enligt Tabell 35 användas. Vidare illustrerar Tabell 35 rapporteringen om en clearad transaktion för värdepappersfinansiering inte omedelbart tas upp i en position (då den skulle rapporteras med åtgärdstypen POSC såsom visas i exemplen nedan).

5.2.1.3 Ny transaktion för värdepappersfinansiering angiven som positionskomponent

197. Tabell 36 och Tabell 37 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i om en ny transaktion för värdepappersfinansiering⁹ anges som positionskomponent. Transaktioner för värdepappersfinansiering inom en position clearad av en central motpart kan rapporteras på följande sätt. Försäkra dig om att ordningsföljderna enligt Tabell 36 och Tabell 37 har planerats med hänsyn till att transaktionen för värdepappersfinansiering ingåtts på en handelsplats och clearats av en central motpart samma dag, vilket innebär att transaktionen för värdepappersfinansiering endast bör anges i clearad form. I samband

⁹ Scenarier med clearade transaktioner för värdepappersfinansiering markeras som tillämpliga på repor även om sådana scenarier inte förväntas i praktiken. Positions nivå kan inte användas vid marginalutlåning.

med exemplen för transaktioner för värdepappersfinansiering som clearats av en central motpart identifieras dessa med den unika transaktionsidentifieraren (UTI-koden) "PUT11".

198. Eftersom detta alternativ utgör kompletterande rapportering till transaktionsnivån sker rapporteringen på följande sätt. Motparterna bör inte ange rapportens spårningsnummer (fält 2.2) för transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart:

Tabell 36 – Ny transaktion för värdepappersfinansiering som ingåtts på en handelsplats, clearats av en central motpart samma dag och rapporterats med positionskomponent på transaktionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <PosCmpnt> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </PosCmpnt> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	POSC ¹⁰	
99	Level	TCTN	

Tabell 37 – Ny transaktion för värdepappersfinansiering som har clearats av en central motpart och rapporterats på positionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUT11	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> </pre>

¹⁰ Observera att de ursprungliga transaktionerna på transaktionsnivå bör rapporteras med positionskomponent som åtgärdstyp.

Tabell 37 – Ny transaktion för värdepappersfinansiering som har clearats av en central motpart och rapporterats på positionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
5	Cleared	true ¹¹	<pre> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>PUTI1</UnqTradIdr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
98	Action type	NEWT ¹²	
99	Level	PSTN ¹³	

5.2.1.4 Ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå

199. Tabell 38 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid modifiering av en tidigare rapporterad transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå.

Tabell 38 – Ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> </pre>
98	Action type	MODI	

¹¹ Trots denna möjlighet kan bilateralt avtalade transaktioner för värdepappersfinansiering inte ersättas av en enskild transaktion, varför samtliga rapporter på positionsnivå ska vara clearade.

¹² I detta exempel skapas en ny position. Vid en clearad transaktion upptagen i en befintlig position skulle den rapporteras som ändring av denna position (med åtgärdstypen MODI).

¹³ Observera att den resulterande clearade transaktionen för värdepappersfinansiering bör rapporteras på positionsnivå och rapportering på positionsnivå endast kan användas som komplettering till rapportering på transaktionsnivå. Följaktligen förväntas rapportering enligt Tabell 36 och Tabell 37.

Tabell 38 – Ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå

No	Field	Example	XML Message
99	Level	TCTN	<pre> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.5 Ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering clearad av en central motpart på positionsnivå

200. Tabell 39 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering som har clearats av en central motpart och tidigare rapporterats på positionsnivå. Detta beror på upptagning av tillkommande transaktioner för värdepappersfinansiering som har ingåtts på transaktionsnivå och clearats av en central motpart samma dag eller någon annan dag. Det finns ingen möjlighet till modifiering av den ursprungliga rapporten på transaktionsnivå när transaktionen väl är upptagen i positionen; en transaktion för värdepappersfinansiering kan dock korrigeras vid felaktigt angivna uppgifter.

Tabell 39 – Ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering clearad av en central motpart på positionsnivå

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	MODI	
99	Level	PSTN	

Tabell 39 – Ändring av en transaktion för värdepappersfinansiering clearad av en central motpart på positionsnivå

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <UnqTradldr>PUTI1</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </Mod> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.6 Korrigering av en transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå

201. Tabell 40 illustrerar ifyllandet av rapporteringsfälten vid korrigering av fält för uppgifter som lämnats in felaktigt i en tidigare rapport om en transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå.

Tabell 40 – Korrigering av en transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </pre>
98	Action type	CORR	
99	Level	TCTN	

Tabell 40 – Korrigering av en transaktion för värdepappersfinansiering på transaktionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.7 Korrigering av en transaktion för värdepappersfinansiering clearad av en central motpart på positionsnivå

202. Tabell 41 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid korrigering av fält för uppgifter som lämnats in felaktigt i en tidigare rapport på positionsnivå om en transaktion för värdepappersfinansiering clearad av en central motpart. Den ursprungliga rapporten på transaktionsnivå behöver inte korrigeras om den var korrekt.

Tabell 41 – Korrigering av en transaktion för värdepappersfinansiering clearad av en central motpart på positionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>PUTI1</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> ... </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	CORR	
99	Level	PSTN	

5.2.1.8 Värdering av transaktioner för värdepappersfinansiering (endast för utlåning eller inlåning av värdepapper)

203. Tabell 42 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid uppdatering av värderingen av värdepapper i en transaktion för utlåning eller inlåning av värdepapper. Motparten värderar de utlånade värdepappren till 1 000 000 euro, vilket i detta fall motsvarar lånebeloppet (fält 2.56); detta tillämpas inte vid åtgärdstypen "VALU". I detta fall rapporterar motparten värderingen av de utlånade värdepappren (fält 2.57) i den valuta som lånet har tagits i. Valutan för marknadskursen anges i xml-taggen.

Tabell 42 – Värdering av transaktioner för värdepappersfinansiering (endast vid utlåning eller inlåning av värdepapper)			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <ValtnUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MktVal Ccy="EUR">1000000</MktVal> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </ValtnUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
57	Market value	1000000	
98	Action type	VALU	

5.2.1.9 Rapportering av uppdatering av säkerhet vid transaktioner för värdepappersfinansiering säkrade på transaktionsnivå

204. Eventuell information om säkerhet bör endast rapporteras med åtgärdstypen COLU. Vid transaktioner för värdepappersfinansiering säkrade på transaktionsnivå bör även UTI-koden för den säkrade transaktionen rapporteras, såsom visas i Tabell 43. Särdragen för rapportering av säkerheter beskrivs i avsnitt 5.4.

205. Detta exempel kan även användas vid rapportering av säkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering rapporterade på positionsnivå om säkerheten hänförs till positionen.

Tabell 43 – Rapportering av uppdatering av säkerheter vid transaktioner för värdepappersfinansiering säkrade på transaktionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		

206. Dessutom gäller att om en transaktion för värdepappersfinansiering tas upp i en position bör eventuell uppdatering av säkerhet rapporteras för denna position och inte för en ursprunglig transaktion för värdepappersfinansiering.

5.2.1.10 Rapportering av uppdatering av säkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering säkrade på nettoexponeringsnivå

207. Eventuella uppgifter om säkerhet bör endast anges med åtgärdstypen COLU, och vid transaktioner för värdepappersfinansiering säkrade på nettoexponeringsnivå krävs det ingen UTI-kod, såsom visas i Tabell 44. Särdragen för rapportering av säkerheter beskrivs i avsnitt 5.4.

Tabell 44 – Rapportering av uppdatering av säkerheter vid transaktioner för värdepappersfinansiering säkrade på nettoexponeringsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)		<pre> < SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		

Tabell 44 – Rapportering av uppdatering av säkerheter vid transaktioner för värdepappersfinansiering säkrade på nettoexponeringsnivå

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </CollUpd> </TradData> ... </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.2.1.11 Förtida avslut av en transaktion för värdepappersfinansiering

208. Tabell 45 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid avslutande av en transaktion för värdepappersfinansiering utan fastställd löptid eller förtida avslut av en transaktion för värdepappersfinansiering med fast löptid. Den nivå (dvs. transaktion eller position) på vilken transaktionen för värdepappersfinansiering rapporteras saknar betydelse i detta användningsfall eftersom fält 2.99 "Nivå" inte används vid denna åtgärdstyp.

Tabell 45 – Förtida avslut av en transaktion för värdepappersfinansiering

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <EarlyTermntn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </EarlyTermntn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
98	Action type	ETRM	
99	Level		

5.2.1.12 Angivelse av en transaktion för värdepappersfinansiering som felaktig

209. Tabell 46 illustrerar hur rapporteringsfälten fylls i vid annullering av en hel rapport som har lämnats in felaktigt för en transaktion för värdepappersfinansiering som aldrig kom till stånd eller som inte omfattades av rapporteringskrav för sådana transaktioner men rapporterades till ett transaktionsregister av misstag. Den nivå (dvs. transaktion eller position) på vilken transaktionen för värdepappersfinansiering rapporteras saknar

betydelse i detta användningsfall eftersom fält 2.99 "Nivå" inte används vid denna åtgärdstyp.

Tabell 46 – Angivelse av transaktioner för värdepappersfinansiering som felaktiga på transaktionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Err> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </Err> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
98	Action type	EROR	
99	Level		

5.3 Uppgifter om lån

210. Avsnitten nedan illustrerar hur man fyller i ett antal fält som har vissa specifika egenskaper av transaktionens lånesida som gemensam nämnare. De möjliggör för de rapporterade motparterna att direkt bedöma den information som de i tillämpliga fall bör rapportera för varje specifikt dataavsnitt.
211. Valideringsreglerna ger fullständig vägledning om vilka fält som är tillämpliga per typ av transaktion för värdepappersfinansiering, åtgärdstyp och nivå samt relevanta beroendeförhållanden.
212. Samtliga exempel och användningsfall nedan använder slumpmässigt genererade koder som inte avser något värdepapper eller någon enhet.

5.3.1 Rapportering av händelsens datum

213. Motparterna bör observera att den rapporterade informationen med avseende på ett visst händelsedatum bör möjliggöra för myndigheter att få en tydlig översikt över exponeringarna till följd av en viss (grupp av) transaktioner för värdepappersfinansiering per slutet av den dag som transaktionen för värdepappersfinansiering avser. Motparterna bör rapportera händelsens datum i enlighet med avsnitt 4.9.6.

5.3.2 Rapportering av clearade respektive ej clearade transaktioner för värdepappersfinansiering

5.3.2.1 Clearade transaktioner för värdepappersfinansiering (öppet erbjudande)

214. När en transaktion clearas enligt modellen för öppet erbjudande sker clearingen vid tidpunkten då transaktionen för värdepappersfinansiering ingås.

215. Tabell 47 illustrerar hur fälten bör fyllas i i den ovannämnda situationen utifrån den centrala motparten O och clearingmedlemmens klients perspektiv, eftersom dessa två är desamma i detta fall.

216. Följande grupp av rapporteringsfält bör fyllas i:

- "Sant" (True) anges i "Clearad" (fält 2.5).
- Datum för "Clearingtillfälle" (fält 2.6) är i detta fall identiskt med fält 2.12 "Genomförandetillfälle".
- LEI-koden för den centrala motparten O anges i "Central motpart" (fält 2.7).

Tabell 47 – Ur den centrala motpartens och clearingmedlemmens synvinkel			
No	Field	Example	XML Message
2	Report tracking number		<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <ExctnDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </RpTrad> </pre>
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	

Tabell 47 – Ur den centrala motpartens och clearingmedlemmens synvinkel

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.2.2 Clearad transaktion för värdepappersfinansiering i en novationsmodell

217. Om en transaktion clearas inom en novationsmodell sker clearingen efter tidpunkten för ingåendet av transaktionen för värdepappersfinansiering.
218. Tabell 48 och Tabell 49 illustrerar hur fälten bör fyllas i utifrån den centrala motparten O:s respektive clearingmedlemmens perspektiv, vid en transaktion för värdepappersfinansiering som har clearats av den centrala motparten O inom en novationsmodell.
219. I detta avseende bör följande grupp av rapporteringsfält fyllas i:
- I "Rapportens spårningsnummer" (fält 2.2) anges den tidigare UTI-koden (UTI för den ursprungliga bilaterala transaktionen vid transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart) men detta får endast anges av clearingmedlemmen och dess klient (alltså inte av den centrala motparten).
 - "True" anges i "Clearad" (fält 2.5).
 - "Clearingtillfälle" (fält 2.6) är senare än fält 2.12 "Genomförandetillfälle".
 - LEI-koden för den centrala motparten O anges i "Central motpart" (fält 2.7).

Tabell 48 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering i en novationsmodell ur den centrala motpartens perspektiv

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> </pre>
2	Report tracking number		
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	

Tabell 48 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering i en novationsmodell ur den centrala motpartens perspektiv

No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	<pre> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

220. Tabell 49 visar exemplet ur clearingmedlemmens perspektiv. Ur klientens perspektiv bör fälten fyllas i på samma sätt.

Tabell 49 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering i en novationsmodell ur clearingmedlemmens perspektiv

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> ... <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm> </RpTrad> </LnData> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
2	Report tracking number	UTI1	
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	

Tabell 49 – Clearad transaktion för värdepappersfinansiering i en novationsmodell ur clearingmedlemmens perspektiv

No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	<pre> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> <RptTrckgNb>UT11</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.2.3 Transaktion för värdepappersfinansiering clearad av en central motpart i en "delivery by value" (DBV)-modell

221. Om en transaktion clearas inom en DBV-modell sker clearingen efter tidpunkten för ingåendet av transaktionen för värdepappersfinansiering.
222. I fält 2.19 anges om transaktionen genomfördes med hjälp av "delivery by value"-mekanismen (DBV).
223. Tabell 50 visar hur fälten fylls i ur den centrala motparten O:s perspektiv. I detta avseende bör följande grupp av rapporteringsfält fyllas i:
 - a. "True" anges i "Clearad" (fält 2.5).
 - b. "Clearingtillfälle" (fält 2.6) är senare än fält 2.12 "Genomförandetillfälle".
 - c. LEI-koden för den centrala motparten O anges i "Central motpart" (fält 2.7).

Tabell 50 – Ur den centrala motpartens perspektiv			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingCondition s</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>
2	Report tracking number		
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04- 22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	
12	Execution timestamp	2020-04- 22T14:41:07Z	
19	Delivery by Value (“DBV”) indicator	true	

Tabell 51 – Ur clearingmedlemmens perspektiv			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report tracking number	UTI1	

Tabell 51 – Ur clearingmedlemmens perspektiv			
No	Field	Example	XML Message
5	Cleared	true	<Rpt> <New>
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<CtrPtyData> ...
7	CCP	{LEI} of CCP O	</CtrPtyData> ...
9	Master agreement Type	OTHR	<LnData> <RpTrad>
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	<UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP>
19	Delivery by Value (“DBV”) indicator	true	<LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.3.2.4 Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering

224. "Felaktig" anges i "Clearad" (fält 2.5) såsom visas i Tabell 52. Övriga fält för clearing fylls inte i. Genomförandetillfället fylls i.

Tabell 52 – Ej clearad transaktion för värdepappersfinansiering			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	
2	Report tracking number		<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UT11</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
5	Cleared	false	
6	Clearing timestamp		
7	CCP		
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	

5.3.3 Handelsplats

225. Fältet "Handelsplats" (fält 2.8) bör fyllas i med hänsyn till vilken typ av transaktion för värdepappersfinansiering som ingåtts. Motparterna bör alltid använda segmentet MIC.
226. Vid en transaktion för värdepappersfinansiering som har ingåtts i ett automatiserat handelssystem (ATS) eller på en mäklarplattform bör MIC-koden för plattformen fyllas i. Ingen LEI-kod får anges i detta fält.

5.3.4 Avsnitt för ramavtal

5.3.4.1 Dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering med ramavtal ur listan

227. Om ett ramavtal används bör följande fält fyllas i:
- "Ramavtalstyp" (fält 2.9).
 - "Ramavtal, version" (fält 2.11) om något annat värde än "BIAG" anges i fält 2.9. "CSDA" eller "OTHR".
228. Om ramavtalet (annat än "BIAG", "CSDA" eller "OTHR") saknar version bör motparterna ange året för tecknandet av avtalet i fältet "Ramavtal, version".

229. Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av program för felåtgärdande av centrala värdepapperscentraler bör anges med "CSDA" som ramavtalstyp.
230. Tabell 53 illustrerar hur relevanta fält fylls i vid en transaktion för värdepappersfinansiering som har ingåtts i enlighet med ramavtalet GMRA 2011.

Tabell 53 – Dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering med ramavtal ur listan			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	GMRA	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> <Vrsn>2011</Vrsn> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
10	Other master agreement type		
11	Master agreement version	2011	

5.3.4.2 Dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering med avtal som inte finns med i listan

231. Om det ramavtal som används är av en annan typ än de avtal som förtecknas i listan (t.ex. den centrala motpartens clearingvillkor för novationstransaktioner eller bilaterala "prime brokerage"-avtal inom marginalutlåning) bör följande fält fyllas i:
- "Ramavtalstyp" (fält 2.9).
 - "Annan ramavtalstyp" (fält 2.10) om "OTHR" anges i fält 2.9.
232. Tabell 54 illustrerar hur relevanta fält fylls i om transaktionen för värdepappersfinansiering ingår i enlighet med ett ramavtal som inte finns med i listan och som avser regelverket för repor av den centrala motparten O.

Tabell 54 – Dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering med ett avtal som inte finns med i listan

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	OTHR	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <LnData> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <RpTrad> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCP O Repo Rulebook</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
10	Other master agreement type	CCP O Repo Rulebook	
11	Master agreement version		

5.3.4.3 Ej dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering

233. Vid en icke-dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering bör följande fält fyllas i (se Tabell 55).

- "Ramavtalstyp" (fält 2.9) där "OTHR" bör anges.
- "Annan ramavtalstyp" (fält 2.10) där "Undocumented" (icke-dokumenterad) bör anges.

Tabell 55 – Icke-dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	OTHR	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> </pre>
10	Other master agreement type	Undocumented	
11	Master agreement version		

Tabell 55 – Icke-dokumenterad transaktion för värdepappersfinansiering			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <LnData> <RpTrad> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>Undocumented</Oth rMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.5 Ingåendet och inledandet av transaktionen

234. De två exemplen nedan illustrerar rapporteringen av två transaktioner för värdepappersfinansiering: a) en som börjar omedelbart och b) en som har en framtida valuteringsdag.
235. Valuteringsdagen bör uppfattas som det överenskomna avvecklingsdatumet i överensstämmelse med definitionen för fält 2.13 i de tekniska tillsynsstandarderna. En tillfällig utebliven avveckling på den förväntade valuteringsdagen kräver ingen kompletterande rapport (t.ex. en "Ändring"), utom om motparterna kommer överens om att ändra eller avsluta transaktionen på grund av utebliven avveckling (i så fall behöver modifierings- eller sluthändelsen rapporteras).

5.3.5.1 Omedelbar transaktion

236. Tabell 56 illustrerar hur relevanta fält fylls i om transaktionen genomförs och inleds inom två dagar, dvs. avvecklingstiden i EU. Detta betraktas som en omedelbar transaktion för värdepappersfinansiering.

Tabell 56 – Omedelbar transaktion			
No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> </pre>
13	Value date (Start date)	2020-04-24	

Tabell 56 – Omedelbar transaktion			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <ExctnDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ExctnDtTm> <ValDt>2020-04-24</ValDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.5.2 Termintransaktion

237. Tabell 57 illustrerar hur relevanta fält fylls i om transaktionen inleds en månad efter dess genomförande, vilket innebär att det rör sig om en termintransaktion för värdepappersfinansiering.

Tabell 57 – Termintransaktion			
No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <ExctnDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ExctnDtTm> <ValDt>2020-05-22</ValDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
13	Value date (Start date)	2020-05-22	

5.3.6 Löptid för transaktionen för värdepappersfinansiering

238. Vid rapportering av minimiuppsägningstid (fält 2.16) bör motparterna ange informationen om antalet bankdagar i enlighet med definitionen av bankdag i det relevanta ramavtalet eller det bilaterala avtal som reglerar transaktionen för värdepappersfinansiering.
239. Om detta fält används vid transaktioner för värdepappersfinansiering vars möjlighet till avslutande inte omfattas av de tekniska standarderna för rapportering (såsom inlösbara repor) bör motparterna ange informationen om den tidigaste återkallelsedagen (fält 2.17) om en sådan finns tillgänglig.
240. Motparterna bör ange minimiuppsägningstiden (fält 2.16) för repor utan fastställd löptid, dvs. om "sant" (true) anges i fält 2.21, samt för automatiskt förnyade ("evergreen") eller förlängda repor, dvs. om ETSB och EGRN anges i fält 2.22.
241. Motparterna bör fylla i fält 2.17 "Tidigaste återkallelsedag" för de transaktioner för värdepappersfinansiering som har möjlighet till avslutande. Om motparterna inte kommit överens om införandet av en ny tidigaste återkallelsedag bör de ange den ursprungliga tidigaste återkallelsedag som gäller för transaktionen för värdepappersfinansiering.

5.3.6.1 Utan fastställd löptid

242. Tabell 58 illustrerar hur relevanta fält fylls i om motparterna kommer överens om en transaktion utan fastställd löptid med en minimiuppsägningstid för avslutande av transaktionen på en dag.

Tabell 58 – Utan fastställd löptid			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)		<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData>
16	Minimum notice period	1	<Rpt> <New>
17	Earliest call-back date		... <CtrPtyData>
21	Open term	true	... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MinNtcePrd>1</MinNtcePrd> <Term> <Opn>NOAP</Opn> </Term> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

5.3.6.2 Fastställd löptid

243. Tabell 59 illustrerar hur relevanta fält fylls i om motparterna kommer överens om utbyte av kontanter, värdepapper eller råvaror mot säkerheter för den avslutande delen (terminsdelen) i transaktionen för värdepappersfinansiering den 22 maj 2020.
244. Uppsägningstiden i exemplet där den ena motparten måste meddela den andra motparten om avslutande av transaktionen för värdepappersfinansiering är fem bankdagar (åtminstone).
245. Det tidigaste datumet då givaren av ett kontantlån kan återkalla en andel av medlen eller avsluta transaktionen är den 7 maj 2020. Även om detta scenario inte hör till vanligheterna kan det ändå förekomma.

Tabell 59 – Fastställd löptid			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)	2020-05-22	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MinNtcePrd>5</MinNtcePrd> <EarlstCallBckDt>2020-05-07</EarlstCallBckDt> </RpTrad> </LnData> </New> <Mod> <LnData> <RpTrad> <Term> <Fxd> <MtrtyDt>2020-05-22</MtrtyDt> </Fxd> </Term> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
16	Minimum notice period	5	
17	Earliest call-back date	2020-05-07	
21	Open term	false	

5.3.7 Möjlighet till avslutande

246. Esma påpekar att motparterna bör ange ett av följande värden i fält 2.22: "EGRN", "ETSB" eller "NOAP". Fält 2.21 ska innehålla ett av följande värden: "sant" (true) eller "felaktig" (false). Om "ETSB" har angetts i fält 2.22 "Möjlighet till avslutande" bör "felaktig" anges i detta fält.
247. Om transaktionen för värdepappersfinansiering är infordringsbar eller inlösbar bör motparterna ange denna information i "Tidigaste återkallelsedag" (fält 2.17).

5.3.8 Allmänna och särskilda säkerhetsarrangemang

248. Fältet "Uppgift om allmänt säkerhetsavtal" (fält 2.18) används endast för värdepapper ställda som säkerhet, inte för utlånade värdepapper.
249. I överensstämmelse med de tekniska tillsynsstandarderna och för konsekvens med de rapporteringsinstruktioner som används i förordningen om penningmarknadsstatistik bör "GENE" anges i samtliga fall där säkerhetsställaren kan välja ut det värdepapper som ställs som säkerhet bland ett urval värdepapper som uppfyller förutbestämda kriterier. Detta inbegriper men är inte begränsat till system för allmänna säkerhetsavtal som tillhandahålls av ett automatiserat handelssystem, såsom system förvaltade av centrala motparter, och transaktioner där säkerheten förvaltas av en trepartsagent. "GENE" bör vara standardangivelsen för de flesta arrangemang för utlåning eller inlåning av värdepapper. "SPEC" bör endast rapporteras i situationer där säkerhetstagaren kräver att en konkret ISIN-kod ska tillhandahållas som säkerhet.
250. Rapportering av säkerhet på grundval av nettoexponering (fält 2.73) är en separat fråga som inte är direkt knuten till typen av säkerhetsarrangemang. Transaktioner som sker på en plattform för allmänna säkerhetsavtal kan säkras antingen på transaktionsbasis eller på nettoexponeringsbasis. Motparterna bör rapportera dem därefter. Rapportering av korgar av säkerheter förklaras i avsnitt 5.4.2 om säkerheter.
251. Om en transaktion för värdepappersfinansiering initialt ingicks som en transaktion med allmänt säkerhetsavtal men har specifika värdepapper som säkerhetstagaren har valt och som tilldelades efter genomförandet blir den omedelbart en transaktion med särskilt säkerhetsavtal. En rapport som avser en transaktion för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "MODI" bör lämnas in med det reviderade värdet för fält 2.18, och den relevanta säkerheten bör rapporteras med åtgärdstypen "COLU".
252. Om motparterna inte har kommit överens om annat bör trepartsrepor rapporteras med "GENE" i fält 2.18 "Uppgift om allmänt säkerhetsavtal".
253. Tabell 60, Tabell 61 och Tabell 62 ger exempel på hur fältet "Uppgift om allmänt säkerhetsavtal" (fält 2.18) bör fyllas i. Observera att dessa tabeller inte nödvändigtvis täcker alla möjliga fall.

5.3.8.1 Särskilt säkerhetsavtal vid äganderättsöverföring

254. Tabell 60 illustrerar hur relevanta fält fylls i om transaktionen för värdepappersfinansiering omfattas av ett särskilt säkerhetsavtal (dvs. då "SPEC" anges i fält 2.18). Sådan säkerhet omfattas av äganderättsöverföring ("TTCA" anges i fält 2.20).

Tabell 60 – Särskilt säkerhetsavtal vid äganderättsöverföring			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	SPEC	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>SPEC</GnlColl> <DlvryByVal>>false</DlvryByVal> <CollDlvryMtd>TTCA</CollDlvryMtd> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

5.3.8.2 Allmänt säkerhetsavtal vid pant

255. Tabell 61 illustrerar hur relevanta fält fylls i om transaktionen för värdepappersfinansiering omfattas av ett allmänt säkerhetsavtal (då "GENE" anges i fält 2.18) och sådan säkerhet omfattas av ett avtal om finansiell säkerhet (då "SICA" anges i fält 2.20).

Tabell 61 – Allmänt säkerhetsavtal vid pant			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	SICA	

Tabell 61 – Allmänt säkerhetsavtal vid pant			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <RpTrad> <GnlColl>GENE</GnlColl> <DlvryByVal>>false</DlvryByVal> <CollDlvryMtd>SICA</CollDlvryMtd> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.8.3 Allmänt säkerhetsavtal med "delivery by value" (DBV) vid äganderättsöverföring

256. Tabell 62 illustrerar hur relevanta fält fylls i om transaktionen för värdepappersfinansiering omfattas av ett allmänt säkerhetsavtal ("GENE" anges i fält 2.18) och sådan säkerhet omfattas av äganderättsöverföring ("TTCA" anges i fält 2.20). Transaktionen har avvecklats med hjälp av DBV-mekanismen ("TRUE" anges i fält 2.19).

Tabell 62 – Allmänt säkerhetsavtal med "delivery by value" (DBV) vid äganderättsöverföring			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>GENE</GnlColl> <DlvryByVal>>true</DlvryByVal> <CollDlvryMtd>TTCA</CollDlvryMtd> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	true	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

Tabell 62 – Allmänt säkerhetsavtal med ”delivery by value” (DBV) vid äganderättsöverföring

No	Field	Example	XML Message
			</TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.3.9 Fasta eller rörliga räntor

257. Vid ingående av transaktioner för värdepappersfinansiering kan motparterna komma överens om användning av antingen fast ränta eller rörlig ränta för transaktionens lånesida. Negativa värden är tillåtna för ”Fast ränta” (fält 2.23) och ”Anpassad rörlig räntesats” (fält 2.35).
258. Vid rapportering av rörliga räntor bör motparterna ange den relevanta räntesatsen och den tillämpade spreaden. Motparterna bör endast uppdatera dessa uppgifter när de kommer överens om ändring av räntesatsen eller spreaden, dock inte dagligen.
259. Vissa rörliga räntor såsom ESTER, SOFR osv. har införts efter publicering av de tekniska tillsynsstandarderna och de tekniska genomförandestandarderna för rapportering. Dessa räntor har ISO-koder. Motparterna bör använda de fastställda koderna för en mer konsekvent rapportering av uppgifterna. Om det finns andra rörliga räntor utan ISO-kod bör motparterna på ett konsekvent sätt ange en alfanumerisk kod.
260. Motparterna bör endast fylla i fält 2.35 ”Anpassad räntesats” och fält 2.36 ”Räntedatum” vid i förväg överenskomna framtida ändringar av räntor som är en del av ingåendet av transaktionen. Övriga ändringar i fasta eller rörliga räntor bör anges i fält 2.23 respektive fält 2.25.
261. Motparterna bör inte rapportera någon ränta kopplad till marknadsvärdet av korta positioner (fält 2.71) i fält 2.23 eller 2.25.

5.3.9.1 Fast ränta – Initial rapportering

262. Om motparter ingår transaktioner för värdepappersfinansiering med fasta räntor bör de fylla i fält 2.23 och fält 2.24 enligt Tabell 63. I detta fall är den årliga räntesatsen ”-0,23455” enligt dagberäkningsmetoden Actual360 (faktiskt antal dagar/360) (”A004”).

Tabell 63 – Fast ränta – Initial rapportering

No	Field	Example	XML Message
1	UTI	UTI1	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
23	Fixed rate	-0.23455	<Rpt> <New>
24	Day count convention	A004	... <CtrPtyData>
98	Action type	NEWT	... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <RpTrad>

Tabell 63 – Fast ränta – Initial rapportering			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <IntrstRate> <Fxd> <Rate>-0.23455</Rate> <DayCntBsis> <Cd>A004</Cd> </DayCntBsis> </Fxd> </IntrstRate> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.9.2 Fast ränta – modifiering

263. Om motparterna kommer överens om modifiering av den fasta räntan, dvs. om införande av en ny räntesats för transaktionen för värdepappersfinansiering, bör de ange modifieringen i fält 2.23 och fält 2.2.4 såsom visas i Tabell 64. I detta fall är den nya årliga räntesatsen "0,12345" medan den nya dagberäkningsmetoden är Actual365Fixed (faktiskt antal dagar/365, fast) ("A005").

Tabell 64 – Fast ränta – modifiering			
No	Field	Example	XML Message
1	UTI	UTI1	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> </LnData> </RpTrad><UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <IntrstRate> <Fxd> <Rate>0.12345</Rate> <DayCntBsis> <Cd>A005</Cd> </DayCntBsis> </Fxd> </pre>
23	Fixed rate	0.12345	
24	Day count convention	A005	
98	Action type	MODI	

Tabell 64 – Fast ränta – modifiering			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </IntrstRate> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.9.3 Rörlig ränta – Initial rapportering

264. Tabell 65 illustrerar hur relevanta fält fylls i om motparterna har ingått en transaktion för värdepappersfinansiering samt valt EONIA som referensränta (fält 2.25) och en referensperiod för den rörliga räntan uttryckt i dagar (fält 2.26) med en heltalsmultiplikator för tidsperioden på 1 dag (fält 2.27).
265. Motparterna har även kommit överens om att betalningsfrekvensen för den rörliga räntan är en vecka (fält 2.28) med en heltalsmultiplikator för tidsperioden på 1 vecka (fält 2.29) vilket anger hur ofta motparterna utbyter betalningar.
266. I detta fall justeras den rörliga räntan med en tidsperiod på dagar (fält 2.30) med en multiplikator på 1 dag (fält 2.31).
267. I detta fall är antalet baspunkter som ska läggas till (eller dras av vid negativt värde, vilket är tillåtet i detta fält) som spread för den rörliga räntan för att bestämma räntesatsen för lånet "5" (fält 2.32).

Tabell 65 – Rörlig ränta – Initial rapportering			
No	Field	Example	XML Message
25	Floating rate	EONA	<SctiesFincgRptgTxRpt>
26	Floating rate reference period - time period	DAYS	<TradData>
27	Floating rate reference period - multiplier	1	<Rpt>
28	Floating rate payment frequency - time period	WEEK	<New>
29	Floating rate payment frequency - multiplier	1	...
30	Floating rate reset frequency - time period	DAYS	<CtrPtyData>
31	Floating rate reset frequency - multiplier	1	...
32	Spread	5	</CtrPtyData>
			<LnData>
			<RpTrad>
			<IntrstRate>
			<Fltg>
			<RefRate>
			<Indx>EONA</Indx>
			</RefRate>
			<Term>
			<Unit>DAYS</Unit>
			<Val>1</Val>

Tabell 65 – Rörlig ränta – Initial rapportering			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Term> <PmtFrqcy> <Unit>WEEK</Unit> <Val>1</Val> </PmtFrqcy> <RstFrqcy> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val> </RstFrqcy> <BsisPtSprd>5</BsisPtSprd> </Fltg> </IntrstRate> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.9.4 Fält för justering av rörlig ränta

268. Justering av rörlig ränta bör rapporteras såsom denna har överenskommit av motparterna. Negativa värden är tillåtna.

5.3.10 Kapitalbelopp för repor och köp- och återförsäljningstransaktioner/sälj- och återköpstransaktioner

269. Tabell 73 illustrerar hur relevanta fält fylls i om kapitalbeloppet på valuteringsdagen är 10 162 756,90 euro och kapitalbeloppet på förfalldagen är 10 161 551,48 euro.

270. Om värdet för kapitalbeloppet på förfalldagen (fält 2.38) fortfarande är okänt kan fältet lämnas tomt enligt valideringsreglerna. Detta fält bör uppdateras senare, när värdet är känt.

271. Vid riktmärken bör det förväntade kapitalbeloppet på förfalldagen anges vid rapporteringstidpunkten och uppdateras när dess varians är känd.

Tabell 66 – Kapitalbelopp för repor, köp- och återförsäljningstransaktioner samt sälj- och återköpstransaktioner			
No	Field	Example	XML Message
37	Principal amount on the value date	10162756.90	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> </pre>
38	Principal amount on the maturity date	10161551.48	

Tabell 66 – Kapitalbelopp för repor, köp- och återförsäljningstransaktioner samt sälj- och återköpsttransaktioner

No	Field	Example	XML Message
39	Principal amount currency	EUR	<pre> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <PrncplAmt> <ValDtAmt Ccy="EUR">10162756.9</ValDtAmt> <MtrtyDtAmt Ccy="EUR">10161551.48</MtrtyDtAmt> </PrncplAmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.11 Lånesidan vid utlåning av värdepapper

272. Vid utlåning eller inlåning av värdepapper inbegriper transaktionens lånesida ett värdepapper som behöver värderas konsekvent av de rapporterade motparterna. "Pris på värdepapper eller råvara" (fält 2.49) bör rapporteras i den valuta som priset på värdepappret eller råvaran anges med. Denna valuta bör anges i "Prisvaluta" (fält 2.50). Vidare bör värdepapperspriset inte inbegripa något krav på marginalsäkerhet eller någon diskontering, uppräknig, påslag eller dylikt. Detta bör i stället rapporteras som en del av säkerhetens marknadsvärde (fält 2.88), även om det har beräknats från transaktionens lånesida.
273. Vid fält 2.46 "Volym eller nominellt belopp" bör ett nominellt belopp endast rapporteras för obligationer. Det nominella värdet bör rapporteras i den ursprungliga valuta som anges i fältet "Valuta för nominellt belopp" (fält 2.48). Andra värdepapper bör rapporteras som en volym, och i detta fall bör "Måttenhet" (fält 2.47) fyllas i medan "Valuta för nominellt belopp" (fält 2.48) lämnas tomt.
274. "Lånebelopp" beräknas i den valuta som värdepappret är uttryckt i enligt formeln nedan, och inte i den valuta som gäller för den transaktion som de två motparterna ingått. "Marknadskurs" speglar å sin sida motparternas värdering av de utlånade värdepappren. Denna värdering kan anges i en annan valuta än den som det utlånade värdepappret uttrycks i. Se även exemplet i avsnitt 5.2.1.8.
275. Lånebeloppet beräknas enligt följande:

$$\text{Lånebelopp (fält 2.56) =}$$

*Volym eller nominellt belopp (fält 2.46) * Pris på värdepapper eller råvara (fält 2.49)*

276. Det kan finnas fall där värderingen av de utlånade värdepappren (eller värdepappren ställda som säkerhet) är omöjlig att göra på grund av att det saknas prisuppgifter. Detta kan till exempel gälla vid tillfälligt upphävda aktier eller vissa värdepapper med fast avkastning inom illikvida marknadssegment. Vid ingående av transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper användning av sådana värdepapper bör motparterna ange den avtalsenligt överenskomna värderingen. Om ny prisinformation blir tillgänglig bör uppdateringar av värderingen rapporteras av båda motparter i fältet "Marknadskurs" (fält 2.57).

5.3.12 Värdepapper

5.3.12.1 Kvalitet på värdepapper/säkerhet

277. Fälten "Kvalitet på värdepapper" (fält 2.51) och "Kvalitet på säkerhet" (fält 2.90) bör fyllas i av de rapporterade enheterna med något av de värden som anges i genomförandestandarderna för rapportering.
278. Värdet "NOAP" bör användas för följande säkerhetstyper (fält 2.94): Aktier som ingår i ett centralt index (MEQU), Andra aktier (OEQU) och Andra tillgångar (OTHR) för vilka kreditbetyg inte gäller (kreditbetyg bör förstås i den mening som avses i förordning (EG) nr 1060/2009 (förordningen om kreditvärderingsinstitut))¹⁴. Värdet "NOTR" bör endast användas för instrument som kan kreditvärderas men som saknar kreditbetyg.
279. För att kunna rapportera denna information och samtidigt undvika att automatiskt förlita sig på kreditbetyg bör motparterna i enlighet med artikel 5a i förordningen om kreditvärderingsinstitut utgå från sina interna bedömningar om kreditkvaliteten på värdepappren, vilket kan inbegripa externa betyg från ett eller flera kreditvärderingsinstitut.
280. Det rapporterade värdet bör i möjligaste mån spegla värdepapprets egenskaper. Om externa betyg har använts som dataunderlag vid ifyllandet av fält 2.51 bör motparterna i idealfallet grunda sina bedömningar på betyget för instrumentet i stället för på betyget för emittenten, om ett sådant finns tillgängligt. Denomineringen av valutan (lokal eller utländsk) och löptiden (kortfristig eller långfristig) bör avspegla värdepapprets egenskaper.
281. Motparterna bör rapportera uppgifter om kvaliteten på värdepapper så konsekvent som möjligt eftersom de används för avstämning. Esmas har dock uppmärksamats på att det kan föreligga eventuella begränsningar som hindrar enheter från att dela denna information. I så fall bör de rapporterade motparterna rapportera det värde som bäst uttrycker deras interna bedömning.

¹⁴ I artikel 3 i förordningen om kreditvärderingsinstitut definieras "kreditbetyg" som en bedömning av kreditvärdigheten hos en enhet, en skuld eller finansiell förpliktelse, räntebärande värdepapper, preferensaktier eller andra finansiella instrument, eller en emittent av en skuld eller finansiell förpliktelse, räntebärande värdepapper, preferensaktier eller andra finansiella instrument, som genomförts med hjälp av ett etablerat och definierat rangordningssystem med olika betygs-kategorier.

5.3.12.2 Obligationer

282. Vid obligationer bör priset anges som ett procenttal, inte som decimalfraktion av 1.
283. Tabell 67 illustrerar hur relevanta fält fylls i vid en transaktion för värdepappersfinansiering som inbegriper statspapper med betyg ”investment grade” och klassificeras som skuldinstrument (obligationer) med nominellt belopp på 100 000 000 euro.
284. I detta exempel emitterades värdepappren av en tysk emittent (fält 2.53) som identifieras genom sin LEI-kod (fält 2.54).
285. Priset på ett värdepapper uttrycks i procent som 99,5 procent (fält 2.49), valutan är euro (fält 2.50) och värdepapprens förfallodag är den 22 april 2030 (fält 2.50).
286. Lånebeloppet för transaktionen för värdepappersfinansiering är 99 500 000 euro (fält 2.56) och låntagaren har ingen exklusiv tillgång till att låna från långivarens värdepappersportfölj (fält 2.68).

Tabell 67 – Obligationer			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<SctiesFincgRptgTxRpt>
41	Security identifier	{ISIN}	<TradData> <Rpt> <New>
42	Classification of a security	{CFI}	... <CtrPtyData>
46	Quantity or nominal amount	100000000	... </CtrPtyData>
48	Currency of nominal amount	EUR	<LnData> <SctiesLndg>
49	Security or commodity price	99.5	<AsstTp> <Scty>
50	Price currency		<Id>DE0010877643</Id>
51	Security quality	INVG	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
52	Maturity of the security	2030-04-22	<NmnlVal> <Amt
53	Jurisdiction of the issuer	DE	Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal>
54	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
55	Security type	GOVS	<Ptrg>99.5</Ptrg> </UnitPric>
56	Loan value	99500000	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
68	Exclusive arrangements	FALSE	<Issr> <Id> <LEI> NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id>
			<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>

Tabell 67 – Obligationer			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <ExclsvArrgmt>>false</ExclsvArrgmt> </Scty> </AsstTp> <LnVal Ccy="EUR">99500000</LnVal> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>DBFTFR</ </pre>

5.3.12.3 Aktier som ingår i ett centralt index

287. Tabell 68 illustrerar hur fälten fylls i vid en transaktion för värdepappersfinansiering som inbegriper aktier som ingår i ett centralt index (fält 2.55) med en volym på 100 000 (fält 2.46). Fält 2.48 används inte eftersom en volym anges i fält 2.46 i stället för ett nominellt belopp.
288. Motparterna bör ange aktier som "MEQU" när de enligt kommissionens genomförandeförordning nr 2016/1646 klassas som sådana.
289. Typen av tillgång är även i detta fall ett värdepapper (fält 2.40) i form av aktier (fält 2.42). Kvaliteten på värdepapper används inte vid denna typ av värdepapper (fält 2.51).
290. I detta exempel har värdepappren emitterats av en tysk emittent (fält 2.53) som identifieras genom sin LEI-kod (fält 2.54).
291. Priset på värdepappret uttrycks i enheter och är 9,95 euro (fält 2.49 och fält 2.50). Värdepappren saknar förfallodag eftersom de underliggande värdepappren är aktier. Därför bör fält 2.52 fyllas i med "9999-12-31" i enlighet med standard ISO 8601.
292. Lånebeloppet för transaktionen för värdepappersfinansiering är 995 000 euro (fält 2.56) och låntagaren har ingen exklusiv tillgång att låna från långgivarens värdepappersportfölj (fält 2.68).

Tabell 68 – Aktier som ingår i ett centralt index			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> </pre>
41	Security identifier	{ISIN}	

5.3.12.4 Andra värdepapper utan förfallodag

293. Tabell 69 illustrerar hur fälten fylls i vid en transaktion för värdepappersfinansiering som inbegriper värdepapper som inte finns med i listan i fält 2.55 i bilaga I till de tekniska genomförandestandarderna. I detta fall bör "other assets" (andra tillgångar) anges i fält 2.55. Volymen för värdepappren är 100 000 (fält 2.46). Fält 2.48 används inte eftersom en volym anges i fält 2.46 i stället för ett nominellt belopp.
294. Typen av tillgång är även här ett värdepapper (fält 2.40) klassificerat som ESVUFN (fält 2.42). "Kvalitet på värdepapper" används inte vid denna typ av värdepapper (fält 2.51).
295. I detta fall har värdepappren emitterats av en fransk emittent (fält 2.53) som identifieras genom sin LEI-kod (fält 2.54).
296. Priset på värdepapper uttrycks i enheter och är i detta fall 99,5 euro (fält 2.49 och fält 2.50). Värdepappren saknar förfallodag; fält 2.52 bör därför fyllas i med "9999-12-31" i enlighet med standard ISO 8601.
297. Lånebeloppet för transaktionen för värdepappersfinansiering är 9 950 000 euro (fält 2.56) och låntagaren har ingen exklusiv tillgång till att låna från långgivarens värdepappersportfölj (fält 2.68).

Tabell 69 – Andra värdepapper utan förfallodag			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<SctiesFincgRptgTxRpt>
41	Security identifier	{ISIN}	<TradData>
42	Classification of a security	{CFI}	<Rpt>
46	Quantity or nominal amount	100000	<New>
49	Security or commodity price	99.5	<CtrPtyData> ...
50	Price currency	EUR	...
51	Security quality	NOAP	</CtrPtyData>
52	Maturity of the security	9999-12-31	<LnData>
53	Jurisdiction of the issuer	FR	<SctiesLndg>
54	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<AsstTp>
55	Security type	OTHR	<Scty>
56	Loan value	9950000	<Id>FR0010877000</Id>
68	Exclusive arrangements	FALSE	<ClssfctnTp> ESVUFN

Tabell 70 – Transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror

No	Field	Example	XML Message
46	Quantity or nominal amount	100000	...
47	Unit of measure	BARL	</CtrPtyData>
49	Securities or commodities price	60	<LnData> <SctiesLndg>
50	Price currency	USD	<AsstTp> <Cmmdty> <Clssfctn> <Nrgy> <Oil> <BasePdct>NRGY</BasePdct> <SubPdct>OILP</SubPdct> <AddtlSubPdct>BRNT</AddtlSubPdct> </Oil> </Nrgy> </Clssfctn> <Qty> <Val>100000</Val> <UnitOfMeasr>BARL</UnitOfMeasr> </Qty> <UnitPric> <MntryVal>
56	Loan value	6000000	<Amt Ccy="USD">60</Amt> </MntryVal> </UnitPric> </Cmmdty> </AsstTp> <LnVal Ccy="USD">6000000</LnVal> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.3.14 Utlåning och inlåning av värdepapper med kontantrabatt

301. Tabell 71 illustrerar hur fälten fylls i när motparterna kommit överens om en rörlig rabattsats på basis av EONIA-indexet (fält 2.59) med en referensperiod för den rörliga rabattsatsen som anges i dagar (fält 2.60) med en heltalsmultiplikator för tidsperioden på 1 dag (fält 2.61).
302. Motparterna har även kommit överens om en betalningsfrekvens på en vecka för betalning av den rörliga rabattsatsen (fält 2.62) och (fält 2.63). Observera att dessa båda fält inte är obligatoriska och är avsedda att underlätta transaktioner där ingen betalningsfrekvens har fastställts för den rörliga rabattsatsen.
303. Den rörliga rabattsatsen justeras med en tidsperiod som anges i dagar (fält 2.64) med en multiplikator på 1 dag (fält 2.65).
304. Antalet baspunkter som läggs till (eller dras av vid negativt värde, vilket är tillåtet i detta fält) som spread för den rörliga räntesatsen i syfte att fastställa räntesatsen för lånet är "5" (fält 2.66).

Tabell 71 – Utlåning eller inlåning av värdepapper med kontantrabatt			
No	Field	Example	XML Message
58	Fixed rebate rate		<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
59	Floating rebate rate	EONA	<New> ...
60	Floating rebate rate reference period - time period	DAYS	<CtrPtyData> ...
61	Floating rebate rate reference period - multiplier	1	</CtrPtyData> <LnData> ...
62	Floating rebate rate payment frequency - time period	WEEK	<TxLnData> <SctiesLndg> ...
63	Floating rebate rate payment frequency - multiplier	1	<RbtRate> <Fltg> <RefRate> <Indx>EONA</Indx>
64	Floating rebate rate reset frequency - time period	DAYS	</RefRate> <Term> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val>
65	Floating rebate rate reset frequency - multiplier	1	</Term> <PmtFrqcy> <Unit>WEEK</Unit> <Val>1</Val>
66	Spread of the rebate rate	5	</PmtFrqcy> <RstFrqcy> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val> </RstFrqcy> <BsisPtSprd>5</BsisPtSprd>

Tabell 71 – Utlåning eller inlåning av värdepapper med kontantrabatt

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Fltg> </RbtRate> </SctiesLndg> </TxLnData> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </TradData> ... </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.3.15 Avgiftsbaserad utlåning eller inlåning av värdepapper: Utlåning eller inlåning av värdepapper med icke-kontant säkerhet, utlåning eller inlåning av värdepapper med kassapool och utlåning eller inlåning av värdepapper utan säkerhet

305. Avgiftsbaserad utlåning eller inlåning av värdepapper omfattar tre typer av utlåningar eller inlåningar av värdepapper: Utlåning eller inlåning av värdepapper med icke-kontant säkerhet, utlåning eller inlåning av värdepapper med kassapool och utlåning eller inlåning av värdepapper utan säkerhet. Samma rapporteringslogik gäller för alla tre typer.

306. Tabell 72 innehåller det värde som motparterna bör ange i fält 67 "Låneavgift" när de ingår avtal om utlåning eller inlåning av värdepapper med icke-kontant säkerhet, med kassapool eller utan säkerhet (utlåning eller inlåning av värdepapper utan rabatt). Låneavgiften är i detta fall 1,23456 procent och den anges utan procenttecken eftersom detta reserverat för xml-taggar.

Tabell 72 – Icke-kontant säkerhet

No	Field	Example	XML Message
67	Lending fee	1.23456	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <LndgFee>1.23456</LndgFee> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </pre>

Tabell 72 – Icke-kontant säkerhet			
No	Field	Example	XML Message
			</New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.3.16 Beloppet av marginallån och marknadsvärdet för korta positioner

307. Det sammanlagda utestående beloppet för marginallån (fält 2.69) bör anges antingen som 0 (om klienten har en allmän kontantkredit/tillräckligt med kontanter) eller som ett positivt värde (om klienten har en allmän kontantskuld/brist på kontanter i basvalutan). Basvalutan bör alltid anges så som den har fastställts i det ömsesidiga avtalet mellan en prime broker och dess klient.
308. Det sammanlagda beloppet av marginallån beräknas utifrån de individuella komponenterna för marginallån efter valuta (fält 2.33 och 2.34). Dessa fält bör upprepas så många gånger det behövs för att få med alla valutor som används i kontot. På så sätt kan myndigheterna få en bild av klientens kontantskuld (dvs. marginallån) i enskilda valutor (och inte bara nettoskulden i basvalutan), samt klientens kontantkredit i enskilda valutor som används som säkerhet. I överensstämmelse med det allmänna marginalutlåningsbeloppet bör klientens nettoskuld i en viss valuta anges som ett positivt värde tillsammans med valutan, medan klientens nettokredit bör anges som ett negativt värde.
309. Marknadsvärdet för korta positioner bör alltid anges som ett värde i marginallånets basvaluta enligt vad som fastställts i det ömsesidiga avtalet (fält 2.70). Det förväntas att ett enda monetärt värde anges per UTI-kod. Marknadsvärdet för korta positioner bör därför anges på nettobasis och vid slutet av dagen. Vad gäller utestående marginallån bör eventuell nettokontantkredit som användes som säkerhet för marknadsvärdet för korta positioner anges som ett negativt värde (fält 2.33) tillsammans med dess valuta (fält 2.34).
310. Om marginallånebeloppet är 0, dvs. om klienten har en nettokontantkredit i basvalutan, och marknadsvärdet för korta positioner också är 0, bör "0" anges i fält 2.33, 2.69 och 2.71. En uppdatering av s.k. nollsäkerhet bör också rapporteras, se förklaringen i avsnitt 5.4.4.

5.3.16.1 Positiva och negativa saldon i vissa valutor och nettoskuld i basvalutan

311. Tabell 73 illustrerar hur rapporteringsfälten bör fyllas i vid nettoskuld i basvalutan som i detta exempel avser en kredit i USD och skulder i GBP och EUR. För enkelhetens skull anges växelkurserna för USD-EUR och GBP-EUR som 1 i exemplet.

Tabell 73 – Positiva och negativa saldon i vissa valutor och skuld i basvalutan			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>

Tabell 73 – Positiva och negativa saldon i vissa valutor och skuld i basvalutan			
No	Field	Example	XML Message
34	Margin lending currency	USD	<Rpt> <New>
33	Margin lending currency amount	50000	<CtrPtyData> ...
34	Margin lending currency	GBP	</CtrPtyData> ...
33	Margin lending currency amount	150000	<LnData> <MrgnLndg>
34	Margin lending currency	EUR	<OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR">150000</OutsdngMrgnLnAmt>
69	Outstanding margin loan	100000	<ShrtMktValAmt Ccy="EUR">0</ShrtMktValAmt>
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	<MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">-
71	Short market value	0	100000</Amt> <Amt Ccy="GBP">50000</Amt> <Amt Ccy="EUR">100000</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.3.16.2 Nettokredit i basvalutan och marknadsvärde för korta positioner

312. Tabell 74 illustrerar hur rapporteringsfälten bör fyllas i vid nettokontantkredit i basvalutan (GBP), där det utestående marginlånet rapporteras som 0 medan klienten använde kontantkredit i icke-basvaluta (USD) som säkerhet för att delvis täcka marknadsvärdet för korta positioner.

Tabell 74 – Kredit i basvalutan och positivt marknadsvärde för korta positioner			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
34	Margin lending currency	USD	<Rpt> <New>
69	Outstanding margin loan	0	<CtrPtyData> ...

Tabell 74 – Kredit i basvalutan och positivt marknadsvärde för korta positioner			
No	Field	Example	XML Message
70	Base currency of outstanding margin loan	GBP	<pre> ... </CtrPtyData> <LnData> <MrgnLndg> <OutsdngMrgnLnAmt Ccy="GBP">0</OutsdngMrgnLnAmt> <ShrtMktValAmt Ccy="GBP">500000</ShrtMktValAmt> <MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">- 100000</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
71	Short market value	500000	

5.3.16.3 Nettokredit i basvalutan och inget marknadsvärde för korta positioner

313. Tabell 75 illustrerar hur rapporteringsfälten bör fyllas i vid kontantkredit i basvalutan (euro) och inget marknadsvärde för korta positioner. Eftersom både utestående marginallån och marknadsvärde för korta positioner saknas kan kontantkrediten inte anges (eftersom den inte används som säkerhet för marginallån eller för marknadsvärdet för korta positioner). Rapportering krävs dock för att underrätta myndigheterna om nollsaldot. Basvalutan enligt den ursprungliga överenskommelsen i det ursprungliga avtalet bör fyllas i.

Tabell 75 – Kredit i basvalutan och inget marknadsvärde för korta positioner			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	0	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <MrgnLndg> <OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR">0</OutsdngMrgnLnAmt> </pre>
34	Margin lending currency	USD	
69	Outstanding margin loan	0	
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	
71	Short market value	0	

Tabell 75 – Kredit i basvalutan och inget marknadsvärde för korta positioner

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <ShrtMktValAmt Ccy="EUR">0</ShrtMktValAmt> <MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">0</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4 Uppgifter om säkerhet

314. I avsnitten nedan beskrivs ifyllandet av en viss grupp av fält som avser vissa egenskaper av säkerheten för en transaktion för värdepappersfinansiering. Detta möjliggör för de rapporterande motparterna att direkt få en uppfattning om den information som bör rapporteras för varje enskilt dataavsnitt när det är tillämpligt.
315. Valideringsreglerna ger fullständig vägledning om de fält som är tillämpliga för varje typ av transaktion för värdepappersfinansiering och varje åtgärdsstyp, samt relevanta beroendeförhållanden.

5.4.1 Rapportering av säkerhet för en utlåning eller inlåning av värdepapper

316. Beroende på om utlåningen eller inlåningen av värdepapper är säkrad eller inte bör motparterna ange dessa uppgifter i fält 2.72 "Indikator för värdepappersfinansiering utan säkerhet".

5.4.1.1 Utlåning eller inlåning av värdepapper utan säkerhet

317. Motparterna bör ange "sant" (true) i fält 2.72 "Indikator för värdepappersfinansiering utan säkerhet" om utlåning av värdepapper utan säkerhet förekommer men är organiserad som en transaktion för utlåning eller inlåning av värdepapper.

5.4.1.2 Utlåning eller inlåning av värdepapper med säkerhet

318. Motparterna bör ange "felaktig" i fältet "Indikator för värdepappersfinansiering utan säkerhet" (fält 2.72) om transaktionen för utlåning eller inlåning av värdepapper är säkrad

eller om motparterna kommer överens om att säkra transaktionen men den särskilda tilldelningen av säkerhet fortfarande är okänd.

5.4.2 Säkerhet

319. Om korgen av säkerheter är okänd vid rapporteringstidpunkten bör "NTAV" anges i fält 2.96. Detsamma gäller för repor som utförs på plattformar för allmänna säkerhetsavtal. I så fall bör motparterna uppdatera identifieringsuppgifterna för korgen av säkerheten så snart dessa blir kända för dem och sedan uppdatera uppgifterna om säkerhetskomponenterna senast arbetsdagen som följer efter valuteringsdagen.
320. Om säkerheten inte avser någon korg av säkerheter förväntar sig Esma att motparterna rapporterar de relevanta säkerhetselementen.

5.4.2.1 En enda transaktion med en korg av säkerheter

321. Tabell 76 illustrerar hur fälten bör fyllas i om två separata transaktioner för värdepappersfinansiering görs mot en korg av säkerheter (fält 2.96) med ISIN-kod "GB00BH4HKS39". Det kan finnas flera transaktioner för värdepappersfinansiering som görs mot en korg av säkerheter utan att detta sedan säkras på grundval av nettoexponering. Transaktionerna för värdepappersfinansiering säkras på transaktionsnivå ("FALSE" anges i fält 2.73).

Tabell 76 – En enda transaktion med en korg av säkerheter			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	
98	Action type	NEWT	

Tabell 76 – En enda transaktion med en korg av säkerheter

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> <BsktIdr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </BsktIdr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	
98	Action type	NEWT	

Tabell 76 – En enda transaktion med en korg av säkerheter

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> <BsktIdr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </BsktIdr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.2.2 En enda transaktion där korgen inte är identifierad vid rapporteringstidpunkten

322. Tabell 77 illustrerar hur fälten bör fyllas i vid en enda transaktion säkrad med en korg av säkerheter där korgen inte kan identifieras vid rapporteringstidpunkten ("NTAV" anges i fält 2.96).
323. Transaktionen för värdepappersfinansiering säkras på nivån av en enda transaktion (fält 2.73). Transaktionen för värdepappersfinansiering säkrad på transaktionsnivå ("FALSE" anges i fält 2.73).

Tabell 77 – En enda transaktion utan korg av säkerheter vid rapporteringstidpunkten

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	

Tabell 77 – En enda transaktion utan korg av säkerheter vid rapporteringstidpunkten

No	Field	Example	XML Message
1.9	Counterparty side	GIVE	<RptgCtrPty> <Id>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
96	Collateral basket identifier	NTAV	
98	Action type	NEWT	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> <BsktIdr> <Id>NTAV</Id> </BsktIdr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.4.2.3 Säkerhet med en korg på grundval av nettoexponering

324. Tabell 78 illustrerar hur fälten bör fyllas i om två transaktioner är säkrade med en korg av säkerheter (fält 2.96) på grundval av nettoexponering ("TRUE" anges i fält 2.73) och identifieras med ISIN-koden "GB00BH4HKS39". Detta är ett exempel och betyder inte att alla transaktioner med allmänna säkerhetsavtal grundar sig på nettoexponering. Motparterna bör rapportera transaktionerna för värdepappersfinansiering när de ingås.
325. Det är värt att notera att när transaktioner för värdepappersfinansiering säkras på grundval av nettoexponering med en korg av säkerheter bör meddelandena "COLU" inkludera de individuella säkerhetskomponenterna. ISIN-koden för korgen rapporteras endast fram till dess att tilldelningen av värdepappren fastställs. Säkerhetskomponenterna bör rapporteras vid dagens slut.

Tabell 78 – På grundval av nettoexponering, med korg			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	
98	Action type	NEWT	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	

Tabell 78 – På grundval av nettoexponering, med korg

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	</Tp> </MstrAgrmt>
9	Master agreement	GMRA	</RpTrad> </LnData>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<CollData> <RpTrad>
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	NEWT	<pre> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> </New> </Rpt> </Rpt> </pre>

Tabell 78 – På grundval av nettoexponering, med korg

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.2.4 Säkerhet på grundval av nettoexponering där korgen av säkerheter inte är identifierad vid rapporteringstidpunkten

326. Tabell 79 illustrerar hur fälten bör fyllas i om en transaktion inte är säkrad med någon korg av säkerheter ("NTAV" anges i fält 2.96), på grundval av nettoexponering ("TRUE" anges i fält 2.73).

327. Transaktionen är säkrad på grundval av nettoexponering (fält 2.73).

Tabell 79 – På grundval av nettoexponering, utan någon korg av säkerheter vid rapporteringstidpunkten

No	Field	Example	XML Message
73	Collateralisation of net exposure	true	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>NTAV</Id> </pre>
96	Collateral basket identifier	NTAV	
98	Action type	NEWT	

Tabell 79 – På grundval av nettoexponering, utan någon korg av säkerheter vid rapporteringstidpunkten

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.3 Kontantsäkerhet

328. Tabell 80 illustrerar rapporteringen av fälten vid transaktioner för utlåning eller inlåning av värdepapper med kontantrabatt och kassapool. I detta exempel är transaktionen säkrad med en kontantsäkerhet på 1 000 000 euro (fält 2.76 och fält 2.77). Scenariot för rapportering är i detta fall detsamma som vid åtgärdstypen "NEWT" och "COLU".

Tabell 80 – Kontantsäkerhet

No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	1000000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">1000000</Amt> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	

5.4.4 Rapportering av nollsäkerhet

329. För enklare rapportering bör säkerheten om denna uppgår till 0 alltid anges som kontantsäkerhet, med 0 som kontantsäkerhetsbelopp och "CASH" som typ av säkerhet. Detta gäller oavsett om den tidigare använda säkerheten för denna transaktion för värdepappersfinansiering var av typen värdepapper, råvaror eller kontanter.
330. Tabell 81 illustrerar rapporteringen av fälten om säkerheten är lika med 0 och typen av säkerhetskomponent är antingen värdepapper, råvaror (endast vid repor, köp- och återförsäljningstransaktioner eller sälj- och återköpstransaktioner) eller kontanter.

Tabell 81 – Rapportering av nollsäkerhet för värdepapper, råvaror och kontanter			
No	Field	Example	XML Message
75	Type of collateral component	CASH	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">0</Amt> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
76	Cash collateral amount	0	
77	Cash collateral currency	EUR	

5.4.5 Fälten för värdepapper som säkerhet

331. Om närmare uppgifter om värdepapper inte finns tillgängliga bör de rapporteras senast valuteringsdagen + 1 dag. Vid problem med avveckling, se avsnitt 5.4.8 i riktlinjerna. Vid korgar av säkerheter där uppgifterna rapporteras en enda gång efter tilldelningen av säkerheten, se avsnitt 5.4.2 i riktlinjerna.

5.4.5.1 Värderingsavdrag

332. Motparter bör ange uppgifter om säkerheter i enlighet med tabell 2 i bilagan till de tekniska tillsynsstandarderna för rapportering.

333. Säkerhetens marknadsvärde (fält 2.88) bör anges till det verkliga värdet exklusive värderingsavdrag. Med andra ord bör säkerhetens marknadsvärde inkludera *hela* säkerheten ställd av säkerhetsställaren, inklusive ineliggande men ej avvecklad säkerhet, före eventuellt värderingsavdrag.
334. Värderingsavdrag eller marginalsäkerhet (fält 2.89) bör rapporteras på ISIN-nivå som ett procenttal vid alla typer av transaktioner för värdepappersfinansiering. Vid repor är värderingsavdraget överenskommet i avtalet och bör vara fastställt för transaktionens löptid, utom om motparterna omförhandlar värderingsavdraget. Värderingsavdraget beräknas som 1 minus kvoten mellan kontant- och säkerhetsvärdet multiplicerat med 100. Till exempel ger en repa med 100 i kontanter och 105 som säkerhet ett värderingsavdrag på $100 * [1 - (100/105)] = 4,7619$ som bör rapporteras som "4,7619". Samma principer tillämpas vid värderingsavdrag på en repa på portföljnivå (dvs. när parterna har kommit överens om att ett enda värderingsavdrag gäller för hela portföljen av reposäkerheter). Som det anges i de tekniska tillsynsstandarderna för rapportering bör värderingsavdrag på portföljnivå även rapporteras på ISIN-nivå, vilket innebär att avdraget bör upprepas för varje ISIN-kod i portföljen (och för kontanter om de ingår i portföljen).
335. Vid utlåning eller inlåning av värdepapper bör "Värderingsavdrag eller marginalsäkerhet" (fält 2.89) endast inkludera de värderingsavdrag som gäller för säkerhetssidan. Kraven på marginalsäkerhet inkluderas i stället genom säkerhetens marknadsvärde (fält 2.88) och beloppet för kontantsäkerhet (fält 2.76). Säkerhetens marknadsvärde och beloppet för kontantsäkerhet bör även uppdateras med eventuella tillägg (såsom uppräknings av lån) som börjar gälla under transaktionens förlopp.
336. Tabell 82 visar uppgifter om säkerhet från en utlåning eller inlåning av värdepapper där värdepapper med värde på 100 000 euro lånas mot en kontantsäkerhet på 100 000 euro (fält 2.76 och fält 2.77), vilket innebär att inget värderingsavdrag gäller och värderingsavdraget anges som 0 (fält 2.89).

Tabell 82 – Kontantsäkerhet utan värderingsavdrag			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	100000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">100000</Amt> </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	

Tabell 82 – Kontantsäkerhet utan värderingsavdrag			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

337. Tabell 83 visar ett utlånat värdepapper med värde på 100 000 euro säkrat med 105 000 amerikanska dollar i kontanter (fält 2.76 och fält 2.77) vilket innebär en marginal på 105 procent på lånesidan.

Tabell 83 – Kontantsäkerhet i utländsk valuta med marginalsäkerhet			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	105000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="USD">105000</Amt> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
77	Cash collateral currency	USD	
89	Haircut or margin	0	

338. I exemplet med en "blandad" säkerhet (Tabell 84) är utlånade värdepapper med värde på 100 000 euro säkrade med 55 000 euro som kontantsäkerhet (fält 2.76) och 60 000 euro som icke-kontant säkerhet (fält 2.88). Detta inkluderar ett krav på marginalsäkerhet (ej specificerat) på lånesidan som gäller för både kontant- och icke-kontantsäkerheten; dessutom tillkommer 5 procents värderingsavdrag på värdet av de värdepapper som används som säkerhet. Fält 2.89 fylls i med "0" för kontantsäkerhet och "5" för värdepapper som används som säkerhet.

Tabell 84 – "Blandad" säkerhet med värderingsavdrag och marginalsäkerhet			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	55000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <MktVal Ccy="EUR">60000</MktVal> </Scty> <HrcutOrMrgn>5</HrcutOrMrgn> </RpTrad> </AsstTp> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	
88	Collateral market value	60000	
89	Haircut or margin	5	<pre> <HrcutOrMrgn>5</HrcutOrMrgn> </Scty> <Csh> <Amt Ccy="EUR">55000</Amt> </Csh> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

339. Negativa värderingsavdrag kan rapporteras i den mån som säkerhetens värde understiger lånets värde. Värderingsavdragets tecken bör inte avvika från angivelsen från motpartens sida.

340. Tabell 85 visar en repa där transaktionen säkras med en korg av värdepapper (inga kontanter i detta fall) och ett värderingsavdrag på portföljnivå gäller för alla värdepapper

som ingår i säkerheten. Samma värderingsavdrag bör rapporteras för varje säkerhetskomponent i portföljen (inklusive kontanter om de ingår i portföljen). Ett lån med ett värde på 150 000 euro är säkrat med två värdepapper, 110 000 euro i värdepapper A och 50 000 i värdepapper B. Det totala marknadsvärdet för den ställda säkerheten är 160 000 euro, vilket motsvarar ett värderingsavdrag på portföljnivå om $100 \cdot [1 - (150/160)] = 6,25$ procent. Detta värde bör anges i fält 2.89 för varje ISIN-kod. På samma sätt bör samma värderingsavdrag anges för varje enskilt värdepapper vid säkerhet på grundval av nettoexponering (fält 2.73).

Tabell 85 – Säkerhetsportfölj med värderingsavdrag på portföljnivå			
No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	110000	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <MktVal Ccy="EUR">110000</MktVal> </Scty> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> <HrcutOrMrgn>6.25</HrcutOrMrgn> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
89	Haircut or margin	6.25	
88	Collateral market value	50000	
89	Haircut or margin	6.25	<pre> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <MktVal Ccy="EUR">50000</MktVal> </Scty> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> <HrcutOrMrgn>6.25</HrcutOrMrgn> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

341. Vid marginalutlåning där ett värderingsavdrag eller ett krav på marginalsäkerhet gäller för hela säkerhetsportföljen bör det angivna värdet i fält 2.89 upprepas för alla ISIN-koder och kontantelement. Om detta inte är fallet och värderingsavdrag i stället tillämpas på

värdepappersbasis bör ISIN-specifika värderingsavdrag eller marginalsäkerheter anges (i samma format som för andra transaktioner för värdepappersfinansiering, dvs. i procent).

5.4.5.2 Typ av säkerhet

342. Motparterna bör ange typ av säkerhet (fält 2.94) med någon av följande koder:
- "GOVS" – Statspapper.
 - "SUNS" – Värdepapper som avser överstatliga organisationer samt byråer.
 - "FIDE" – Räntebärande värdepapper (inbegripet säkerställda obligationer) emitterade av banker och andra finansinstitut.
 - "NFID" – Företagsobligationer (inbegripet säkerställda obligationer) emitterade av icke-finansiella företag.
 - "SEPR" – Värdepapperiserade produkter (inbegripet CDO, CMBS, ABCP).
 - "MEQU" – Aktier som ingår i ett centralt index (inbegripet konvertibla obligationer).
 - "OEQU" – Andra egetkapitalinstrument (inbegripet konvertibla obligationer).
 - "OTHR" – Andra tillgångar (inklusive aktier i gemensamma fonder).
343. För andra värdepapper får motparterna åberopa andra officiella källor för att minimera risken för inkonsekvenser och avstämningsproblem. För definition av statspapper bör rapporterade enheter använda fotnot 19 i FSB:s standarder för insamling av uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som referens och åberopa den standardiserade Basel III-metoden. Om någon av motparterna inte berörs av Basel III-kraven bör motparterna komma överens om vilket värde som bör anges i fältet.
344. Skillnaden mellan "Aktier som ingår i ett centralt index" och "Andra aktier" grundar sig på definitionerna i FSB:s standarder. Det är dock FSB:s medlemmar som bestämmer vilka index som ska godkännas som "centrala", förutsatt att dessa definieras i enlighet med tillämpningen av FSB/BCBS-ramen för värderingsavdrag på ej centralt clearade transaktioner för värdepappersfinansiering.
345. Esmas tekniska genomförandestandarder för centrala index och börser erkända enligt kapitalkravsförordningen¹⁵ innehåller en förteckning över centrala index (bilaga I, tabell 1 och 2). Förteckningen inkluderar index för aktier och konvertibla obligationer som omfattar tillgångar inom och utanför EU. Förteckningen bör användas som referens vid klassificering av aktier och konvertibla obligationer som "ingår i ett centralt index" eller "andra".

5.4.5.3 Möjlighet till återanvändning av säkerhet

346. Motparterna bör fylla i detta fält endast med beaktande av den avtalsenliga möjligheten till återanvändning av säkerheten. När "Metod för ställande av säkerhet" (fält 2.20) anges som "TTCA" eller "SIUR" bör "Möjlighet till återanvändning av säkerhet" (fält 2.95) alltid anges som "TRUE". Operativa begränsningar eller tillsynskrav som kan hindra

¹⁵ Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2016/1646 av den 13 september 2016.

återanvändning bör inte beaktas här. Den avtalsenliga möjligheten till återanvändning bör styras av det ramavtal som definierar typen av säkerhetsarrangemang som används vid transaktionen för värdepappersfinansiering.

347. Till exempel bör en motpart som överlämnar säkerheten från den ena clearingmedlemmen till den andra under "TTCA" rapportera att återanvändning av säkerheten är möjlig, även om motparten hindras från detta enligt den centrala motpartens clearingvillkor. Samma gäller för fondföretag: en erhållen icke-kontantsäkerhet som kan återanvändas bör rapporteras som sådan, även om den inte kan återanvändas enligt Esmas riktlinjer om problem med börshandlade fonder och andra fondföretag.
348. Slutligen bör det noteras att "Möjlighet till återanvändning av säkerhet" inte tar hänsyn till om säkerheten har återanvänts eller ska återanvändas. Först när säkerheten återanvänds – vilket innefattar användning av lånade värdepapper enligt arrangemang för utlåning eller inlåning av värdepapper – bör en kompletterande återanvändningsrapport skickas in (se avsnitt 5.6.1).

5.4.5.4 "Plain vanilla"-obligationer

349. Tabell 86 illustrerar rapporteringen av "plain vanilla"-obligationer som används som säkerhet den 24 april 2020.
350. Som säkerhet i en repotransaktion användes i detta fall 102 000 000 euro i räntebärande tyska statspapper identifierade med ISIN-kod "DE0010877643" och klassificerade som "DBFTFR" med ett värderingsavdrag på 2 procent och förfalldag den 22 april 2030. Värdepappren är kända och rapporteras i enlighet med tidsschemat för rapportering tillsammans med övriga uppgifter på lånesidan. Kvaliteten på värdepappren är "investment grade" – "INVG" – och senare återanvändning av säkerheten är möjlig. Tabellen fokuserar endast på de fält som har betydelse för säkerhetsrapportering.
351. Valutan för säkerhetens nominella belopp eller volym är en frivillig uppgift, men den bör anges om ett nominellt belopp rapporteras. Om en volym anges (t.ex. vid aktier) bör detta fält inte fyllas i.
352. Vad gäller säkerhetens valuteringsdag används detta fält endast vid utlåning eller inlåning av värdepapper i samband med förutbetalda säkerhet.
353. Definitionen av priset per enhet (fält 2.87) anger att det rapporterade värdet bör inkludera den upplupna räntan vid räntebärande värdepapper, dvs. marknadsvärdet.

Tabell 86 – "Plain vanilla"-obligationer			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ...
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	

Tabell 86 – ”Plain vanilla”-obligationer			
No	Field	Example	XML Message
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	<LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</LnData> <CollData>
86	Price currency		<RpTrad> <AsstTp>
87	Price per unit	102	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
88	Collateral market value	102000000	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <NmnlVal>
89	Haircut or margin	2	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
90	Collateral quality	INVG	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
91	Maturity date of the security	2030-04-22	<UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	</UnitPric> <MktVal
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	Ccy="EUR">102000000</MktVal>
94	Collateral type	GOVS	<HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
95	Availability for collateral reuse	true	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
98	Action type	NEWT	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.4.5.5 Eviga obligationer

354. Tabell 87 illustrerar rapporteringen av 102 000 000 euro i spanska eviga statsobligationer som används som säkerhet. Ett värderingsavdrag på 2 procent tillämpas. Värdepappren är kända och rapporteras i enlighet med tidsschemat för rapportering tillsammans med övriga uppgifter på lånesidan. Kvaliteten på värdepappren är "investment grade" – "INVG" – och återanvändning av säkerheten är möjlig. Tabellen fokuserar enbart på de fält som har betydelse för rapportering av säkerheter.
355. Valutan för säkerhetens nominella belopp eller volym är en frivillig uppgift, men den bör anges om ett nominellt belopp rapporteras. Om en volym anges (t.ex. vid aktier) bör detta fält inte fyllas i.
356. Vad gäller säkerhetens valuteringsdag används detta fält endast vid utlåning eller inlåning av värdepapper i samband med förutbetalda säkerhet.
357. Definitionen av pris per enhet (fält 2.87) anger att det rapporterade värdet bör inkludera den upplupna räntan för räntebärande värdepapper, dvs. marknadsvärdet.

Tabell 87 – Eviga obligationer			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>ES0010877643</Id> </pre>
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	102	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	2	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	9999-12-31	
92	Jurisdiction of the issuer	ES	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	

Tabell 87 – Eviga obligationer			
No	Field	Example	XML Message
94	Collateral type	GOVS	<pre> <HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE </LEI> </Id> <JursdctnCtry>ES</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
95	Availability for collateral reuse	true	
98	Action type	NEWT	

5.4.5.6 Aktier som ingår i ett centralt index

358. Tabell 88 illustrerar rapporteringen av aktier som ingår i ett centralt index ("MEQU") som används som säkerhet, i detta fall totalt 105 000 000 euro i franska CAC40-aktier med CFI-kod ESVUFN och ett värderingsavdrag på 5 procent. Värdepappren är kända och rapporteras i enlighet med tidsschemat för rapportering tillsammans med övriga uppgifter på lånesidan. "NOAP" anges i fältet "Kvalitet på säkerheten" eftersom inget betyg tillämpas på dessa värdepapper. Senare återanvändning är möjlig.
359. Valutan för säkerhetens nominella belopp eller volym är en frivillig uppgift, men den bör anges om ett nominellt belopp rapporteras. Om en volym anges (t.ex. vid aktier) bör detta fält inte fyllas i.
360. Vad gäller valuteringsdagen för säkerheten används detta fält endast vid utlåning eller inlåning av värdepapper i samband med förutbetalda säkerhet.
361. Definitionen av pris per enhet (fält 2.87) anger att det rapporterade värdet bör inkludera den upplupna räntan för räntebärande värdepapper, dvs. marknadsvärdet.

Tabell 88 – Aktier som ingår i ett centralt index

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
75	Type of the collateral component	SECU	<Rpt> <New>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<CtrPtyData>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</CtrPtyData> <LnData>
83	Collateral quantity or nominal amount	10000000	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad>
86	Price currency	EUR	</LnData> <CollData>
87	Price per unit	10.5	<RpTrad> <AsstTp>
88	Collateral market value	105000000	<Scty> <Id> FR0000120271</Id> <ClssfctnTp> ESVUFN
89	Haircut or margin	5	</ClssfctnTp>
90	Collateral quality	NOAP	<QtyOrNmnlVal> <Qty>100000000</Qty> </QtyOrNmnlVal>
91	Maturity date of the security	9999-12-31	<UnitPric> <MntryVal>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<Amt> Ccy="EUR">10.5</Amt> </MntryVal>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</UnitPric> <MktVal>
94	Collateral type	MEQU	Ccy="EUR">105000000</MktVal>
95	Availability for collateral reuse	true	<HrcutOrMrgn>5</HrcutOrMrgn> <Qlty>NOAP</Qlty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id>
98	Action type	NEWT	<LEI>529900S21EQ1BO4ESM68</LEI> </Id> <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp>

Tabell 88 – Aktier som ingår i ett centralt index			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> </RpTrad> </CollData> ... </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.6 Tilläggsmarginalsäkerhet på transaktionsnivå för ej centralt clearade transaktioner för värdepappersfinansiering

362. Hänvisningar till utlåning eller inlåning av värdepapper eller repor i detta underavsnitt är endast avsedda som exempel med olika ramavtal. Andra typer av transaktioner för värdepappersfinansiering, såsom köp- och återförsäljningstransaktioner, sälj- och återköpstransaktioner eller transaktioner för värdepappersfinansiering som inbegriper råvaror, bör dock rapporteras enligt samma principer.
363. Vidare hänvisar exemplen i detta underavsnitt till tilläggsmarginalsäkerhet på nivån av individuella transaktioner för värdepappersfinansiering. Exemplet i avsnittet nedan illustrerar i stället rapporteringen av tilläggsmarginalsäkerhet med säkerhet på grundval av nettoexponering.
364. Minustecken för säkerhetskomponenter som ingår i tilläggsmarginalsäkerhet på nettoexponeringsnivå visar läget vid slutet av dagen, inte flödet för denna dag. Även om de kan sammanfalla rent numeriskt är skillnaden mellan dem grundläggande. Motparterna bör således rapportera läget för varje säkerhetskomponent vid dagens slut. Närmare vägledning anges i avsnitt 373.
365. För enkelhetens skull anges värderingsavdrag i exemplen nedan som 0. Motparterna bör rapportera värderingsavdraget genom beräkningar i enlighet med avsnitt 5.4.5.1.

5.4.6.1 Tilläggsmarginalsäkerhet på en utlåning eller inlåning av värdepapper med ytterligare anslag av samma värdepapper av säkerhetsställaren

366. Tabell 89 illustrerar en uppdatering av tilläggsmarginalsäkerhet vid utlåning eller inlåning av värdepapper i exemplet med "plain vanilla"-obligation i Tabell 86: en ökning på 1 000 099 av det nominella beloppet för en säkerhet ställd som ersättning för minskning av obligationspriset från 102 till 100,99, enligt säkerhetsställarens rapport. Säkerhetsställaren och säkerhetstagaren bör rapportera informationen om säkerheten på exakt samma sätt, såsom anges i Tabell 89.

Tabell 89 – Uppdatering av tilläggsmarginalsäkerhet till utlåning eller inlåning av värdepapper			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> </pre>

Tabell 89 – Uppdatering av tilläggsmarginälsäkerhet till utlåning eller inlåning av värdepapper

No	Field	Example	XML Message
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<CollUpd> ...
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	<CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	<LEI>12345678901234500000</LEI>
3	Event date	24/04/2020	</Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id>
75	Type of the collateral component	SECU	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	101000099	</CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		<UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
87	Price per unit	100.99	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	102000000	<Tp>GMSLA</Tp> </Tp>
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </SctiesLndg>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData> <SctiesLndg>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<Collsd> <AsstTp>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	

Tabell 89 – Uppdatering av tilläggsmarginälsäkerhet till utlåning eller inlåning av värdepapper

No	Field	Example	XML Message
98	Action type	COLU	<pre> <Amt Ccy="EUR">101000099</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.6.2 Tilläggsmarginälsäkerhet på en repa med ytterligare anslag av samma värdepapper av säkerhetsställaren

367. Tabell 90 illustrerar en uppdatering av tilläggsmarginälsäkerhet vid en repa i exemplet med "plain vanilla"-obligation i Tabell 86: en ökning på 1 000 099 av det nominella beloppet för en säkerhet ställd som ersättning för minskning av obligationspriset från 102

till 100,99, enligt säkerhetsställarens rapport. Säkerhetsställaren och säkerhetstagaren bör rapportera informationen om säkerheten på exakt samma sätt, såsom anges i Tabell 90.

Tabell 90 – Uppdatering av tilläggsmarginälsäkerhet till en repa			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	101000099	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100.99	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	

Tabell 90 – Uppdatering av tilläggsmarginssäkerhet till en repa

No	Field	Example	XML Message
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp>
94	Collateral type	GOVS	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">101000099</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal>
98	Action type	COLU	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.4.6.3 Tilläggsmarginälsäkerhet på en utlåning eller inlåning av värdepapper med återlämnande av samma värdepapper till säkerhetsställaren

368. Tabell 91 illustrerar en annorlunda uppdatering av säkerheten än i exemplet i Tabell 86, nämligen en minskning på 999 709 euro av det nominella beloppet för säkerheten ställd som ersättning för ökning av obligationspriset från 102 till 103,03, enligt säkerhetsställarens rapport. Säkerhetsställaren och säkerhetstagaren bör rapportera informationen om säkerheten på exakt samma sätt, såsom anges i Tabell 91.

Tabell 91 – Tilläggsmarginälsäkerhet på en utlåning eller inlåning av värdepapper med återlämnande av samma värdepapper till säkerhetsställaren			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </SctiesLndg> </LnData> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </SctiesLndg> </LnData> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	99000291	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	103.03	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	0	

Tabell 91 – Tilläggsmarginälsäkerhet på en utlåning eller inlåning av värdepapper med återlämnande av samma värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
			</TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

5.4.6.4 Tilläggsmarginälsäkerhet på en repa med återlämnande av samma värdepapper till säkerhetsställaren

369. Tabell 92 illustrerar en annorlunda uppdatering av säkerheten än i exemplet i Tabell 86, nämligen en minskning på 999 709 euro av det nominella beloppet för säkerheten ställd som ersättning för ökning av obligationspriset från 102 till 103,03, enligt säkerhetsställarens rapport. Säkerhetsställaren och säkerhetstagaren bör rapportera informationen om säkerheten på exakt samma sätt, såsom anges i Tabell 92.

Tabell 92 – Tilläggsmarginälsäkerhet på en repa med återlämnande av samma värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	99000291	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	

Tabell 92 – Tilläggsmarginälsäkerhet på en repa med återlämnande av samma värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
86	Price currency		<pre> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> </Scty> </RpTrad> </CollData> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">99000291</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> </MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </pre>
87	Price per unit	103.03	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	

Tabell 92 – Tilläggsmarginalsäkerhet på en repa med återlämnande av samma värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.7 Tilläggsmarginalsäkerhet för ej centralt clearade transaktioner för värdepappersfinansiering vid säkerhet på grundval av nettoexponering

370. Vid säkerhet på grundval av nettoexponering kan motparterna förutom utbyte av säkerhet som en del av transaktionen även komma överens om säkring av de lån som ingår enligt samma typ av ramavtal på nettobasis.
371. Av denna anledning förekommer det fall där vissa säkerhetskomponenter som säkerhetsställaren har ställt på nettobasis kan återlämnas av säkerhetstagaren. Detta ska säkerställa antingen att ingen överskjutande säkerhet finns för gruppen av säkrade transaktioner, eller att säkerheten inte överskrider någon värderingsavdrags- eller marginaltröskel som eventuellt har överenskommit mellan motparterna.
372. Det finns även fall där de värdepapper som återlämnas av säkerhetstagaren inte exakt motsvarar de som ursprungligen ställdes av säkerhetsställaren. I så fall blir det nödvändigt att identifiera överföringsriktningen för att exponeringarna och säkerhetsnivån ska kunna beräknas korrekt.
373. Därför gäller följande för att säkra konsekvent rapportering av säkerhet vid befintlig säkerhet på grundval av nettoexponering:
- När de två motparterna utbyter säkerhet vid ej centralt clearade transaktioner för värdepappersfinansiering som en del av tilläggsmarginalsäkerhet på grundval av nettoexponering bör de i XML-schemat ange beloppet för värdepapper och deras marknadsvärde med det tecken som anger läget för varje värdepapper ur motpartens eget perspektiv.
 - Om säkerhetsställaren lägger till extra säkerhet som tilläggsmarginalsäkerhet bör denne ange den nya säkerhetens marknadsvärde på grundval av nettoexponering med ett minustecken.
 - Om säkerhetstagaren återlämnar en del av samma extra säkerhet som denne redan har ställt som tilläggsmarginalsäkerhet bör denne ange den nya säkerhetens marknadsvärde på grundval av nettoexponering med ett plustecken, medan säkerhetsställaren bör ange den nya säkerhetens nettomarknadsvärde med ett minustecken.

- d. Om säkerhetsställaren erhåller säkerhetskomponenter som skiljer sig från de säkerhetskomponenter som ursprungligen ställdes bör denne ange säkerhetens marknadsvärde för dessa nya säkerhetskomponenter med ett plustecken.
- e. Säkerhetstagaren bör däremot ange med ett plustecken de säkerhetskomponenter som erhållits som en del av tilläggsmarginälsäkerhet och med ett minustecken de säkerhetskomponenter som lämnats till säkerhetsställaren och som skiljer sig från de säkerhetskomponenter som ursprungligen erhöles.
374. Denna typ av rapportering gäller endast för COLU-meddelanden där i) säkerhet på grundval av nettoexponering används och ii) ingen UTI-kod har rapporterats för säkerhetskomponenten/-komponenterna. Denna rapportering används inte vid tilldelningar av säkerhet på transaktionsbasis.
375. Vid varje säkerhet på grundval av nettoexponering bör motparterna skicka COLU-meddelanden för varje transaktion för värdepappersfinansiering som säkras på transaktionsnivå och ett enda COLU-meddelande för den säkerhet som används som tilläggsmarginälsäkerhet.
- 5.4.7.1 Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet mot kassapool för utlåning eller inlåning av värdepapper som säkras med kontantsäkerhet på transaktionsnivå
376. I exemplet i Tabell 93 säkras utlåningar eller inlåningar av värdepapper initialt med kontantsäkerhet (utlåning eller lån av värdepapper med kontanrabatt) varefter motparterna anger tilläggsmarginälsäkerheten mot en kassapool.
377. Inget värderingsavdrag tillämpas normalt på kontanterna och i detta fall beräknas även marginälsäkerheten på lånesidan som noll. När det gäller de specifika fallen värderingsavdrag och marginälsäkerheter bör motparterna följa riktlinjerna i underavsnitt 5.4.5.1 i avsnitt 5.4.4.

Tabell 93 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet mot kassapool för utlåning eller inlåning av värdepapper som säkras med kontantsäkerhet på transaktionsnivå			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </OthrCtrPty> </CtrPtyData> </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	

Tabell 93 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet mot kassapool för utlåning eller inlåning av värdepapper som säkras med kontantsäkerhet på transaktionsnivå

No	Field	Example	XML Message
75	Type of the collateral component	CASH	</ld> </OthrCtrPty>
76	Cash collateral amount	100000000	<OthrPtyData> <AgtLndr>
77	Cash collateral currency	EUR	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
98	Action type	COLU	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</CtrPtyData> <LnData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<UnqTradldr>UT1</UnqTradldr> <MstrAgrmt>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Tp> <Tp>GMSLA</Tp>
3	Event date	24/04/2020	</Tp> </MstrAgrmt>
9	Master agreement	GMSLA	</SctiesLndg> </LnData>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<CollData> <SctiesLndg>
75	Type of the collateral component	CASH	<Collsd> <AsstTp>
76	Cash collateral amount	100000000	<Scty> </Scty>
77	Cash collateral currency	EUR	<Csh> <Amt
98	Action type	COLU	Ccy="EUR">100000000</Amt> </Csh>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</Collsd> </SctiesLndg>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</CollData> ...
3	Event date	24/04/2020	</CollUpd> </Rpt>
9	Master agreement	GMSLA	<Rpt> <CollUpd>

Tabell 93 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet mot kassapool för utlåning eller inlåning av värdepapper som säkras med kontantsäkerhet på transaktionsnivå

No	Field	Example	XML Message
75	Type of the collateral component	CASH	<LEI>12345678901234500000</LEI>
76	Cash collateral amount	5000000	</Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
77	Cash collateral currency	EUR	<Id>
98	Action type	COLU	<pre> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> <SctiesLndg> <Collsd> <AsstTp> <Scty> </Scty> <Csh> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </Csh> </AsstTp> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> </pre>

Tabell 93 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet mot kassapool för utlåning eller inlåning av värdepapper som säkras med kontantsäkerhet på transaktionsnivå

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> <SctiesLndg> <Collsd> <AsstTp> <Scty> </Scty> <Csh> <Amt Ccy="EUR">5000000</Amt> </Csh> </AsstTp> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </pre>

Tabell 93 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet mot kassapool för utlåning eller inlåning av värdepapper som säkras med kontantsäkerhet på transaktionsnivå

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.7.2 Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor som initialt säkras på transaktionsnivå och sedan inkluderas i en nettningsmängd

378. Tabell 94 visar säkerheten för tre UTI-koder som initialt säkrades på transaktionsbasis. Dessa tre repor inkluderades dock i en nettningsmängd och den påföljande säkerhetsrapporteringen innehåller de säkerhetselement som avser de individuella transaktioner för värdepappersfinansiering identifierade med deras UTI-koder och säkerheten använd på grundval av nettoexponering.

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd.

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginalsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd.

No	Field	Example	XML Message
86	Price currency		<pre> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> </Scty> </AsstTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">100000000</MktVal> </MktVal> </NmnlVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> </Id> </Issr> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </RpTrad> </CollData> </LnData> </MstrAgrmt> </UnqTradIdr> </pre>
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	100000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	50000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	FR	

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd.

No	Field	Example	XML Message
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp>
94	Collateral type	GOVS	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
98	Action type	COLU	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI>
3	Event date	24/04/2020	</Id>
9	Master agreement	GMRA	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
75	Type of the collateral component	SECU	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</Scty> </AsstTp>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</RpTrad> </CollData>
84	Collateral unit of measure		... </CollUpd>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</Rpt> <Rpt>
86	Price currency		<CollUpd> <CtrPtyData>
87	Price per unit	100	<CtrPtyData> <RptgCtrPty>
88	Collateral market value	50000000	<Id>

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd.

No	Field	Example	XML Message
89	Haircut or margin	0	<pre> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradlDr>UTI2/UnqTradlDr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> </pre>
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	FR	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	5000000	
84	Collateral unit of measure		

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginssäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd.

No	Field	Example	XML Message
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<pre> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id> <JurstdctnCtry>FR</JurstdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> </pre>
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	5000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2040	
92	Jurisdiction of the issuer	NL	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd.

No	Field	Example	XML Message
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	</AgtLndr>
84	Collateral unit of measure		</OthrPtyData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</CtrPtyData>
86	Price currency		</CtrPtyData>
87	Price per unit	100	<LnData>
88	Collateral market value	2000000	<RpTrad>
89	Haircut or margin	0	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
90	Collateral quality	INVG	<UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<MstrAgrmt>
92	Jurisdiction of the issuer	IT	<Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Tp>GMRA</Tp>
94	Collateral type	GOVS	</Tp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</MstrAgrmt>
75	Type of the collateral component	SECU	</RpTrad>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</LnData>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<CollData>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	<RpTrad>
84	Collateral unit of measure		<AsstTp>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Scty>
86	Price currency		<Id>NL0010877643</Id>

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginalsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd.

No	Field	Example	XML Message
87	Price per unit	100	</Issr> <Tp>
88	Collateral market value	2000000	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
89	Haircut or margin	0	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
90	Collateral quality	INVG	</Scty> </AsstTp>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
92	Jurisdiction of the issuer	ES	</RpTrad>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</CollData> ...
94	Collateral type	GOVS	</CollUpd> </Rpt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
98	Action type	COLU	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt>

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd.

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>IT00BH4HKS39</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">2000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>IIIIIIIIIIIIIIIIIIII</LEI> </Id> <JursdctnCtry>IT</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> <Scty> <Id>ES0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> </pre>

Tabell 94 – Nettoexponering – Tilläggsmarginalsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd.

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>2000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE</LEI> </Id> <JursdctnCtry>ES</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.7.3 Nettoexponering – Tilläggsmarginalsäkerhet på utlåningar eller inlåningar av värdepapper säkrade mot en icke-kontantsäkerhetspool med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

379. Tabell 95 illustrerar en mer komplicerad uppdatering av säkerhet. Det finns ingen säkerhet på transaktionsbasis; den ursprungliga transaktionen ingicks mot en säkerhetspool. I detta exempel har priset på en av de säkerheter som användes för att säkra exponeringen (dvs. priset på tyska statsobligationer) ökat från 102 till 103,3, men säkerhetstagaren behöver tyska statsobligationer medan säkerhetsställaren går med på att få franska statsobligationer i stället. De två motparterna kommer överens om följande ersättning: säkerhetstagaren återlämnar 2 000 000 euro (till nominellt värde) av den säkerhet som utgörs av franska statsobligationer. På så sätt ersätter man för överskjutande

marknadsvärde av tyska obligationer på 2 060 000 euro med 2 060 000 euro i marknadsvärdet för franska obligationer som innehas av säkerhetsställaren (dvs. med ett minustecken ur säkerhetstagarens perspektiv) vilket återställer den ursprungliga nettobalansen för säkerheten.

380. Observera att de fält som avser värdepapper i det upprepningsbara säkerhetsuppgiftsavsnittet bör upprepas två gånger för att alla relevanta uppgifter ska kunna anges. Bägge värdepappren kan återanvändas senare.
381. Säkerhetsställaren och säkerhetstagaren bör rapportera uppgifterna om säkerhet i enlighet med Tabell 95 och ange de relevanta tecknen för de säkerhetskomponenter som ingår i tilläggsmarginälsäkerheten på grundval av nettoexponering i enlighet med avsnitt 373.

Tabell 95 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på utlåning eller inlåning av värdepapper säkrade mot en säkerhetspool med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	101000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	103.03	

Tabell 95 – Nettoexponering – Tilläggsmarginalsäkerhet på utlåning eller inlåning av värdepapper säkrade mot en säkerhetspool med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	104060300	<Tp> <Tp>GMSLA</Tp>
89	Haircut or margin	0	</Tp> </MstrAgrmt>
90	Collateral quality	INVG	</SctiesLndg> </LnData>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<CollData> <SctiesLndg>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<Collsd> <AsstTp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
94	Collateral type	GOVS	<ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt
75	Type of the collateral component	SECU	Ccy="EUR">101000000</Amt> </NmnlVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">104060300</MktVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	-2000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr>
86	Price currency		<Id>
87	Price per unit	103.015	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI>
88	Collateral market value	-2060300	</Id>
89	Haircut or margin	0	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>
90	Collateral quality	INVG	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Scty> <Scty> <Id>FR0010877643</Id>

Tabell 95 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på utlänning eller inlänning av värdepapper säkrade mot en säkerhetspool med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
94	Collateral type	GOVS	<ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">- 2000000</Amt> <Sgn>>true</Sgn> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.015</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">- 2060300</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF </LEI> </Id>
98	Action type	COLU	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.4.7.4 Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

382. Exemplet i Tabell 96 är en fortsättning av exemplet i Tabell 94. I detta fall återlämnas det ena värdepappret som ställts som tilläggsmarginälsäkerhet, men mängden är större än den initiala mängd som ställdes som tilläggsmarginälsäkerhet.

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	<MstrAgrmt>
88	Collateral market value	100000000	<Tp>GMRA</Tp>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </RpTrad>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<RpTrad> <AsstTp>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
94	Collateral type	GOVS	<NmnlVal> <Amt
95	Availability for collateral reuse	TRUE	Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	Ccy="EUR">100000000</MktVal>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
86	Price currency		<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr>
87	Price per unit	100	<Id>
88	Collateral market value	50000000	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> > </Id>
89	Haircut or margin	0	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>
90	Collateral quality	INVG	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Scty> <Scty>
94	Collateral type	GOVS	<Id>DE0010877643</Id>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
98	Action type	COLU	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</NmnlVal>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
3	Event date	24/04/2020	<Issr> <Id>
9	Master agreement	GMRA	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> >
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</Id>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
84	Collateral unit of measure		</Scty> </AsstTp>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
86	Price currency		</RpTrad> </CollData>
87	Price per unit	100	... </CollUpd>
88	Collateral market value	50000000	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
89	Haircut or margin	0	<CtrPtyData> <CtrPtyData>
90	Collateral quality	INVG	<RptgCtrPty> <Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<LEI>12345678901234500000</LEI>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	</Id> </RptgCtrPty>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<OthrCtrPty> <Id>
94	Collateral type	GOVS	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData>
98	Action type	COLU	<AgtLndr>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</AgtLndr> </OthrPtyData>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	<UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <MstrAgrmt>
3	Event date	24/04/2020	<Tp> <Tp>GMRA</Tp>
9	Master agreement	GMRA	</Tp> </MstrAgrmt>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</RpTrad>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
84	Collateral unit of measure		<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
86	Price currency		<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg>
87	Price per unit	100	</UnitPric> <MktVal
88	Collateral market value	50000000	Ccy="EUR">50000000</MktVal>
89	Haircut or margin	0	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginssäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningssmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
90	Collateral quality	INVG	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
94	Collateral type	GOVS	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	... </CollUpd>
3	Event date	24/04/2020	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
9	Master agreement	GMRA	<CtrPtyData> <CtrPtyData>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<RptgCtrPty> <Id>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
84	Collateral unit of measure		</OthrCtrPty> <OthrPtyData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<AgtLndr>
86	Price currency		<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
87	Price per unit	100	</OthrPtyData>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	2000000	</CtrPtyData> </CtrPtyData>
89	Haircut or margin	0	<LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
90	Collateral quality	INVG	<UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<MstrAgrmt> <Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	IT	<Tp>GMRA</Tp> </Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</MstrAgrmt> </RpTrad>
94	Collateral type	GOVS	</LnData> <CollData>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<RpTrad> <AsstTp>
98	Action type	COLU	<Scty> <Id>NL0010877000</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg>
3	Event date	24/04/2020	</UnitPric> <MktVal
9	Master agreement	GMRA	Ccy="EUR">50000000</MktVal>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI>
83	Collateral quantity or nominal amount	-2000000	</Id>
84	Collateral unit of measure		<JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
86	Price currency		</Tp>
87	Price per unit	100	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
88	Collateral market value	-2000000	</Scty> </AsstTp>
89	Haircut or margin	0	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
90	Collateral quality	INVG	</RpTrad> </CollData>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	... </CollUpd>
92	Jurisdiction of the issuer	ES	</Rpt> <Rpt>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<CollUpd> <CtrPtyData>
94	Collateral type	GOVS	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
98	Action type	COLU	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>IT00BH4HKS39</Id> <ClssfctnTp> DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> <Sgn>true</Sgn> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">2000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>IIIIIIIIIIIIIIIIIIII</LEI> </Id> <JursdctnCtry>IT</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> </pre>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>ES0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTPR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt> Ccy="EUR">101000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">- 2000000</MktVal> </pre>

Tabell 96 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd med återlämnande av likvärdiga (men inte samma) värdepapper till säkerhetsställaren

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEEEE </LEI> </Id> <Jurisdiction>ES</Jurisdiction> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.7.5 Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd (Tabell 97)

383. Detta exempel är en variant av de föregående exemplen på tilläggsmarginälsäkerhet med värdepapper på grundval av nettoexponering. De tre transaktionerna för värdepappersfinansiering identifierade med UTI1, UTI2 och UTI3 säkrades på transaktionsnivå med värdepapper och sedan har motparterna kommit överens om att tillhandahålla kontanter som tilläggsmarginälsäkerhet. Säkerhetsställaren tillhandahåller ytterligare kontanter för att täcka exponeringen.

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> <QtyOrNmnlVal> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> </QtyOrNmnlVal> </CollData> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	100000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd

No	Field	Example	XML Message
94	Collateral type	GOVS	<NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">100000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI > </Id> <JurisdictionCtry>DE</JurisdictionCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> <Scty> <Id>FR0010877643</Id> <ClassfctnTp>DBFTFR </ClassfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	50000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	FR	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd

No	Field	Example	XML Message
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<pre> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id> <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </pre>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	
84	Collateral unit of measure		
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	50000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	FR	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd

No	Field	Example	XML Message
98	Action type	COLU	</AgtLndr>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</OthrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</CtrPtyData>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender B	</CtrPtyData>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	<LnData>
3	Event date	24/04/2020	<RpTrad>
9	Master agreement	GMRA	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<UnqTradldr>UT12</UnqTradldr>
75	Type of the collateral component	SECU	<MstrAgrmt>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Tp>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Tp>GMRA</Tp>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</Tp>
84	Collateral unit of measure		</MstrAgrmt>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</RpTrad>
86	Price currency		</LnData>
87	Price per unit	100	<CollData>
88	Collateral market value	50000000	<RpTrad>
89	Haircut or margin	0	<AsstTp>
90	Collateral quality	INVG	<Scty>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<Id>FR0010877643</Id>

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd

No	Field	Example	XML Message
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
94	Collateral type	MEQU	</Scty> </AsstTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	GOVS	</RpTrad> </CollData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	... </CollUpd>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
75	Type of the collateral component	CASH	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI>
76	Cash collateral amount	2000000	</Id> </OthrCtrPty>
77	Cash collateral currency	EUR	<OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt>

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <Qty>50000000</Qty> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">10</Amt> </MntryVal> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> </MktVal> </UnitPric> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI> </Id> </Issr> <JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </pre>

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> </Csh> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnIn d> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </pre>

Tabell 97 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet med kontanter på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.7.6 Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginälsäkerhet krävs.

384. Tabell 98 är en fördjupning av exemplet i Tabell 97, men i detta fall är det viktiga elementet att ingen ytterligare säkerhet utbyts vid dagens slut som tilläggsmarginälsäkerhet för säkerheten på grundval av nettoexponering. Logiken för rapportering liknar rapporteringen av nollsäkerhet i avsnitt 5.4.4.

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginälsäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginälsäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
86	Price currency		<UnqTradldr>UT1</UnqTradldr>
87	Price per unit	100	<MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt>
88	Collateral market value	100000000	</RpTrad> </LnData>
89	Haircut or margin	0	<CollData> <RpTrad>
90	Collateral quality	INVG	<AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
94	Collateral type	GOVS	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<MktVal Ccy="EUR">100000000</MktVal>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<Issr> <Id>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> >
87	Price per unit	100	</Id>
88	Collateral market value	50000000	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>
89	Haircut or margin	0	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginälsäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
92	Jurisdiction of the issuer	FR	</Scty> <Scty>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
94	Collateral type	GOVS	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
98	Action type	COLU	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<MktVal>50000000</MktVal>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Issr> <Id>
3	Event date	24/04/2020	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
9	Master agreement	GMRA	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</Issr> <Tp>
75	Type of the collateral component	SECU	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</Scty> </AsstTp>
83	Collateral quantity or V nominal amount	50000000	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
84	Collateral unit of measure		</RpTrad> </CollData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	... </CollUpd>
86	Price currency		</Rpt> <Rpt>
87	Price per unit	100	<CollUpd> <CtrPtyData>

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginälsäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	50000000	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Id>
94	Collateral type	GOVS	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
98	Action type	COLU	</AgtLndr>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT13	</Tp>
3	Event date	24/04/2020	</MstrAgrmt>
9	Master agreement	GMRA	</RpTrad>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp>
75	Type of the collateral component	SECU	<Scty> <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginälsäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
84	Collateral unit of measure		<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
86	Price currency		<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
87	Price per unit	100	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
88	Collateral market value	50000000	<Issr> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	</Issr> <Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
94	Collateral type	GOVS	</Scty> </AsstTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	COLU	<Id>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</RpTrad> </CollData> ... </CollUpd>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	<Id>
9	Master agreement	GMRA	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
75	Type of the collateral component	CASH	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI>
76	Cash collateral amount	0	</Id> </OthrCtrPty>

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginälsäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginälsäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
77	Cash collateral currency	EUR	<pre> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI> </pre>
98	Action type	COLU	

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginssäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginssäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </ld> <JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <ld> <LEI>12345678901234500000</LEI> </ld> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <ld> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </ld> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> </pre>

Tabell 98 – Nettoexponering – Tilläggsmarginssäkerhet på repor initialt säkrade på transaktionsnivå och sedan inkluderade i en nettningsmängd. Priset på positionen är stabil denna dag och ingen tilläggsmarginssäkerhet krävs.

No	Field	Example	XML Message
			<pre> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">0</Amt> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.8 Förutbetalad säkerhet för utlåning eller inlåning av värdepapper

385. Vid rapportering av den uttryckliga tilldelningen av säkerhet för en nettoexponering bör uppdateringen av säkerhet innefatta motparternas LEI-koder, ramavtalet, säkerhetens valuteringsdag och den konkreta tilldelningen av säkerhet, så att uppdateringen av säkerheten kan kopplas till de befintliga transaktionerna för värdepappersfinansiering. Fältet "Valuteringsdag för säkerheten" (fält 2.74) används endast i samband med utlåning eller inlåning av värdepapper.
386. Händelsens datum anger det förväntade avvecklingsdatumet för säkerheten. Genom att jämföra motparternas LEI-koder, ramavtalet och datumfälten i den ursprungliga transaktionsrapporten och i uppdateringen av säkerheten kan man fastställa vilka transaktioner som uppdateringen av säkerhet för ett utestående nettobelopp avser. I exemplet i Tabell 99 bör säkerheten rapporteras på basis av den förväntade avvecklingen som ägde rum 2020-04-23 och som anges som "Händelsens datum" (fält 2.3). "Valuteringsdag för säkerheten" (fält 2.74) anger det datum från vilket säkerhetsuppdateringen gäller för de utestående lånen (säkerheten är med andra ord inte längre "förutbetalad" från 2020-04-24). Följaktligen skulle säkerhetens valuteringsdag vara kopplad till valuteringsdagen och förfallodagen för de transaktioner för

värdepappersfinansiering som har samma LEI-koder för motparterna och samma ramavtal för att fastställa för vilka transaktioner som säkerhetsuppdateringen gäller.

Tabell 99 – Förutbetalda säkerhet			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-23	<pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <SciesLndg> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> </SciesLndg> </LnData> <CollData> <SciesLndg> <Collsd> <CollValDt>2020-04- 24</CollValDt> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> </Scty> </AsstTp> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> </MktVal> <HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> </Issr> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> <Tp> </pre>
74	Value date of the collateral	2020-04-24	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
84	Collateral unit of measure		
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	102	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	2	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	2030-04-22	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	true	

Tabell 99 – Förutbetalad säkerhet			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre>

5.4.9 Portfölj av clearade transaktioner

387. När fält 2.97 (Portföljkod) fylls i bör motparterna se till att de använder koden på ett konsekvent sätt i sina rapporter. Om en kod identifierar en portfölj som säkrar transaktioner som även inbegriper derivat bör motparterna använda samma kod som användes vid rapportering i enlighet med förordningen om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister.
388. Vidare gäller att värdet för portföljkoden inte behöver vara helt unik, men den bör användas konsekvent. Eftersom fält 2.97 innehåller ett icke-matchande värde behöver detta värde inte överenskommas mellan motparterna i transaktionen.

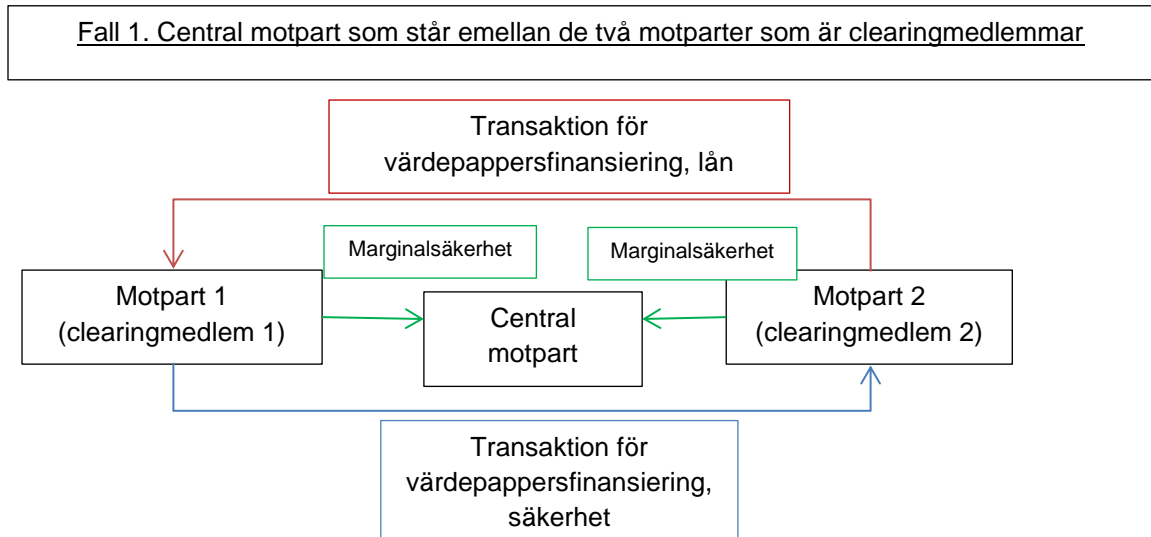
5.5 Uppgifter om marginalsäkerhet

389. Uppgifterna i detta avsnitt bör rapporteras av alla motparter vars transaktioner för värdepappersfinansiering har clearats centralt utom då dessa motparter omfattas av obligatorisk delegering i enlighet med artikel 4.2; i så fall bör de rapporteras av den enhet som anges i den artikeln.
390. För att kunna utnyttja en central motparts tjänster ställer både clearingmedlem 1 och clearingmedlem 2 en marginalsäkerhet till den centrala motparten. Marginalsäkerheten består av en initial marginalsäkerhet och en tilläggs marginalsäkerhet¹⁶. Den marginalsäkerhet som ställs av clearingmedlemmarna till den centrala motparten har ingen direkt anknytning till säkerheten för transaktionen för värdepappersfinansiering. Den centrala motparten använder marginalsäkerheten för täckning av samtliga risker till följd av de transaktioner som den clearar åt respektive clearingmedlemmar. Den marginalsäkerhet som clearingmedlemmarna ställer till den centrala motparten kan även

¹⁶ Det kan även finnas en överskjutande marginalsäkerhet som utgörs av den del av säkerheten som överskrider den erforderliga nivån.

täcka risker till följd av andra transaktioner än transaktioner för värdepappersfinansiering såsom transaktioner med derivat.

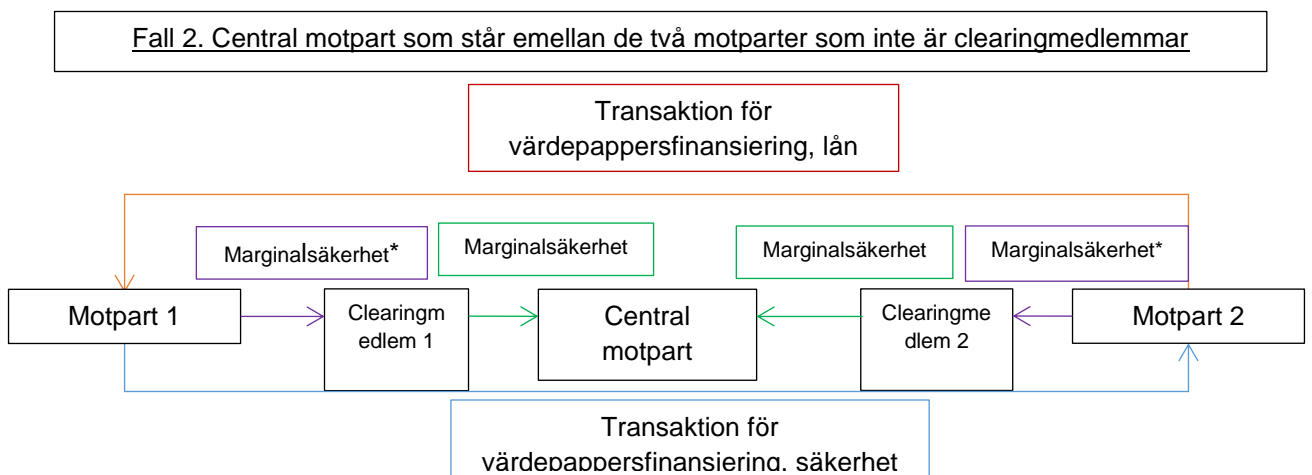
5.5.1 Central motpart som står emellan de två motparter som är clearingmedlemmar



391. Om en motpart inte själv är clearingmedlem kan den marginalsäkerhet som denne ställer till clearingmedlemmen (se "marginalsäkerhet*" i fall 2 nedan) avvika från den marginalsäkerhet som clearingmedlemmen ställer till den centrala motparten.

5.5.2 Central motpart som står emellan de två motparter som inte är clearingmedlemmar

•



5.5.3 Rapportering av uppgifter om marginalsäkerhet

392. Om det finns en tredje typ av marginalsäkerhetsutbyte bör motparterna komma överens om denna och rapportera den på ett konsekvent sätt som antingen initial marginalsäkerhet eller tilläggs marginalsäkerhet.

393. Initial marginalsäkerhet, tilläggsmarginssäkerhet och överskjutande marginalsäkerhet anges var och en som ett enskilt värde som utgörs av bruttovärdet (före värderingsavdrag) för alla erhållna/ställda/pantsatta tillgångsklasser. Om den clearade portföljen inte innehåller några derivat rekommenderas det att använda den centrala motpartens basvaluta. Om det däremot finns rapporterbara derivat i enlighet med förordningen om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister bör samma valuta användas.
394. Uppgifterna om marginalsäkerhet gäller endast för transaktioner för värdepappersfinansiering clearade av en central motpart. I fallet i Tabell 100 använder enheten samma portfölj för säkerhet som enligt förordningen om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister. Den rapporterade motparten (motpart J, som även är clearingmedlem) använder delegerade rapporteringstjänster av motpart D. Denne rapporterar beloppet 1 000 000 euro ställt som initial marginalsäkerhet och beloppet 300 000 euro ställt som tilläggsmarginssäkerhet till den centrala motparten O. Motparten rapporterar även en överskjutande säkerhet på 100 000 euro.

Tabell 100 – Uppgifter om marginalsäkerhet			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxMrgnDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <TradUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	<RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting Counterparty	{LEI} of counterparty J	<EvtDt>2020-04-23</EvtDt> <CtrPty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty J	<RptgCtrPty>
6	Other counterparty	{LEI} of CCP O	<LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI>
7	Portfolio code	EMIRSFTRC ODE1	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
8	Initial margin posted	1000000	<LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI>
9	Currency of the initial margin posted	EUR	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
10	Variation margin posted	300000	<LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI>
11	Currency of the variation margins posted	EUR	</NttyRspnsblForRpt> <RptSubmitgNtty>
12	Initial margin received		<LEI>11223344556677889900</LEI>
13	Currency of the initial margin received		</RptSubmitgNtty> </CtrPty>
14	Variation margin received		<CollPrftlId>EMIRSFTRCODE1</CollPrftlId>

Tabell 100 – Uppgifter om marginalsäkerhet			
No	Field	Example	XML Message
15	Currency of the variation margins received		<PstdMrgnOrColl> <InitlMrgnPstd Ccy="EUR">1000000</InitlMrgnPstd>
16	Excess collateral posted	100000	<VartnMrgnPstd Ccy="EUR">300000</VartnMrgnPstd>
17	Currency of the excess collateral posted	EUR	<XcssCollPstd Ccy="EUR">100000</XcssCollPstd> </PstdMrgnOrColl>
18	Excess collateral received		<RcvdMrgnOrColl>
19	Currency of the excess collateral received		... </RcvdMrgnOrColl>
20	Action type	MARU	</TradUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxMrgnDataRpt>

5.6 Uppgifter om återanvändning, återinvestering av kontanter och finansieringskällor

395. Som det påpekas i de tekniska tillsynsstandarderna skiljer sig logiken bakom tabell 4 i bilagan till tillsynsstandarderna för rapportering från övriga tabeller och används inte för avstämning eftersom denna information inte kan kopplas till individuella transaktioner. I stället rapporteras återanvändning av icke-kontantsäkerhet, återinvestering av kontantsäkerhet och finansieringskällor sammanlagda på nivån av rapporterande enhet.
396. Vidare gäller att om uppgifter om återanvändning av säkerhet, återinvestering av kontanter eller finansieringskällor rapporteras vid olika tidpunkter bör åtgärdstypen "NEWT" endast anges i den första rapporten för en viss kombination av rapporterande motpart och enhet som ansvarar för rapportering, oavsett vilka fält den omfattar. Den relevanta åtgärdstypen bör anges i de påföljande rapporterna för denna kombination.

5.6.1 Återanvändning av säkerhet

397. Återanvändning av säkerhet bör rapporteras med hjälp av den formel som har överenskommit i FSB-ramen¹⁷ och anges i de tekniska tillsynsstandarderna. Marknadsaktörer skiljer normalt inte mellan sina egna tillgångar och den säkerhet som de har fått från motparter (förutsatt att värdepappren i säkerheten kan återanvändas). Meningen med FSB-formeln är därför att enheter ska ange en uppskattning av det säkerhetsbelopp som de återanvänder på basis av den andel av säkerhet som de har fått jämfört med deras egna tillgångar.
398. Rapporteringsskyldigheten avser endast transaktioner för värdepappersfinansiering, vilket innebär att den inte omfattar värdepapper som ställs eller erhålls från andra transaktioner

¹⁷ FSB Non-cash collateral re-use: Measure and metrics. (Återanvändning av icke-kontant säkerhet: Mätning och mätsystem) <http://www.fsb.org/wp-content/uploads/Non-cash-Collateral-Re-Use-Measures-and-Metrics.pdf>

som säkerhet. Säkerheter ställda som marginalsäkerhet vid derivattransaktioner eller andra transaktioner utanför tillämpningsområdet för förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering (se avsnitt 4.2.1) bör med andra ord inte tas med i formeln.

399. Detta innebär även att komponenterna av återanvändningsformeln inte bör rapporteras separat till Esma. I stället bör rapporterade enheter endast ange den uppskattning som följer av användningen av formeln på ISIN-nivå.
400. Om ingen faktisk återanvändning har ägt rum lämnas detta rapportfält tomt. När säkerheten inte längre används rapporteras den som "uppdatering av återanvändning" (REUU) med värdet "0".
401. Om rapporteringen delegerats ansvarar den motpart till vilken rapporteringen har delegerats inte för rapportering av den uppskattade återanvändningen av säkerheten. Icke-finansiella företag ansvarar själva för beräkning av den uppskattade återanvändningen och inlämnandet i tid av uppskattningen till den rapporteringsansvariga motparten.
402. Om motparterna föredrar att rapportera den faktiska (i stället för den uppskattade) återanvändningen är detta tillåtet.
403. Inom FSB-ramen definieras termen "säkerhet" i allmänhet genom dess ekonomiska funktion, vilket innebär att den ska uppfattas som värdepapper, oavsett transaktionens juridiska struktur. När det gäller omfattningen inbegriper *mottagna säkerheter som kan återanvändas*
 - a. värdepapper erhållna som säkerhet vid omvända repor och köp- och återförsäljningstransaktioner,
 - b. värdepapper lånade vid transaktioner för inlåning av värdepapper,
 - c. värdepapper erhållna som säkerhet vid transaktioner för utlåning av värdepapper,
 - d. värdepapper erhållna som tilläggssäkerhet för att uppfylla de krav på tilläggs marginalsäkerhet som utgår från transaktioner för värdepappersfinansiering.
404. Pantsatta initiala marginalsäkerheter som är isolerade och blockerade (t.ex. i samband med derivat), och därför inte kan återanvändas, bör inte inkluderas i uppskattningen.
405. Vid marginalutlåning beror möjligheten till återanvändning av säkerhet inte bara på den typ av säkerhetsarrangemang som används vid transaktionen, utan även på avtalsenliga gränser ("återpansättningsgräns") som prime broker-institutet och dess klient har kommit överens om. Denna gräns beräknas som en fast procentandel av det dagliga utestående marginallånebeloppet. För att säkerheten ska kunna användas bör värdepapper med rätt till återpansättning först överföras från klientens konto till prime broker-institutets konto inom den angivna gränsen. Esma föreslår att vid beräkningen av återanvändningsformeln bör *den mottagna säkerhet som kan återanvändas* utesluta värdepapper ställda som säkerhet som inte kan överföras till prime broker-institutets konto på grund av den avtalsenliga gränsen för återpansättning. De deponerade men ej tilldelade värdepappren bör inte tas med här. Om sådana värdepapper togs med skulle det leda till övervärdering av det säkerhetsbelopp som faktiskt återanvänds.

406. På liknande sätt inbegriper ställd säkerhet

- a. värdepapper ställda som säkerhet vid repor och sälj- och återköpstransaktioner,
- b. utlånade värdepapper,
- c. värdepapper ställda som säkerhet vid transaktioner för inlåning av värdepapper,
- d. värdepapper ställda som säkerhet för att kunna uppfylla kraven på tilläggsmarginälsäkerhet som utgår från transaktioner för värdepappersfinansiering.

407. Varje värdepapper erhållet eller ställt som en del av transaktioner utanför tillämpningsområdet för förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering, bland annat transaktioner för värdepappersfinansiering som ingår med ESCB-motparter, bör uteslutas ur återanvändningsformeln.

408. Centrala motparter bör ur sina uppskattningar om återanvändning utesluta de värdepapper som överförs som säkerhet mellan clearingmedlemmar som en del av deras centrala clearingverksamhet. Detta gäller både för komponenten "Erhållen säkerhet" och komponenten "Återanvänd säkerhet" i formeln. Dessa säkerheter används inte av den centrala motparten per se eftersom överföring av värdepappren snarare avspeglar den novationsprocess som äger rum när en central motpart träder emellan de två ursprungliga motparterna. De värdepapper som tas emot som marginälsäkerhet bör i tillämpliga fall inkluderas i uppskattningarna och centrala motparter förväntas rapportera eventuell återanvändning som sker som en del av deras övriga aktiviteter. Detta inkluderar finansförvaltning och alla andra typer av system eller mekanismer (t.ex. omvända värdepapperslån) som centrala motparter kan ha infört.

409. Enligt mätsystemet för återanvändning av säkerheter¹⁸ som ingår i FSB:s ramverk ska beräkningen göras direkt av nationella eller internationella myndigheter utifrån den återanvändning av säkerheter som har rapporterats av enheter. För återanvändningsgraden behöver myndigheterna beräkna nämnaren utifrån de uppgifter som enheter har rapporterat i tabell 2.

5.6.1.1 Återanvändning av värdepapper av ett finansiellt företag eller ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) utan delegering av rapportering

410. Tabell 101 visar ett fall där motpart B rapporterar återanvända värdepapper med ISIN-kod IT00BH4HKS39 till ett värde av 10 000 000 euro.

Tabell 101 – Återanvändning av värdepapper av ett finansiellt företag eller ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) utan delegering av rapportering			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd>
2	Event date	2020-04-23	

¹⁸ Se avsnitt 4 i FSB:s ramverk för finansiell stabilitet om återanvändning av icke-kontanta säkerheter.

Tabell 101 – Återanvändning av värdepapper av ett finansiellt företag eller ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) utan delegering av rapportering			
No	Field	Example	XML Message
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	SECU	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty>
7	Collateral component	{ISIN}	<NttyRspnsblForRpt>
8	Value of reused collateral		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
9	Estimated reuse of collateral	10000000	</CtrPtyData> <CollCmpnt>
10	Reused collateral currency	EUR	<Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal>
18	Action type	REUU	<Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

5.6.1.2 Återanvändning av värdepapper av ett finansiellt företag eller ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) med delegering av rapportering

411. Tabell 102 visar ett fall där motpart A delegerar rapporteringen till motpart B, som rapporterar återanvända värdepapper med ISIN-kod IT00BH4HKS39 till ett värde av 10 000 000 euro.

Tabell 102 – Återanvändning av värdepapper av ett finansiellt företag eller ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) med delegering av rapportering			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN> IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	10000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

5.6.1.3 Återanvändning av värdepapper av ett icke-finansiellt företag (ett litet eller medelstort företag) med en motpart

412. Tabell 103 visar ett fall där motpart C är ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) som har ingått transaktioner för värdepappersfinansiering med en enda enhet – motpart B (finansiellt företag). Motpart B rapporterar återanvända värdepapper med ISIN-kod IT00BH4HKS39 till ett värde av 10 000 000 euro.

Tabell 103 – Återanvändning av värdepapper av en icke-finansiell motpart som är litet eller medelstort företag med en motpart			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI> ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	10000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

5.6.1.4 Återanvändning av värdepapper av ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) med flera motparter

413. Tabell 104 och Tabell 105 visar de uppgifter som bör rapporteras vid återanvändning av ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) med flera motparter. I detta exempel används två tabeller. Det kan dock finnas lika många tabeller som motparter med vilka det icke-finansiella företaget (litet eller medelstort företag) har ingått transaktioner för värdepappersfinansiering och sedan återanvänt säkerheten.

414. I detta fall är motpart C ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) och den har ingått transaktioner för värdepappersfinansiering med två enheter – motpart B och motpart D. Motpart B rapporterar återanvända värdepapper med ISIN-kod IT00BH4HKS39 till ett värde av 10 000 000 euro i Tabell 104. Motpart D rapporterar återanvända värdepapper med ISIN-kod FR00BH4HKS3 till ett värde av 2 000 000 euro i Tabell 105.

Tabell 104 – Återanvändning av värdepapper av ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) med flera motparter (1)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN> IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	10000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

Tabell 105 – Återanvändning av värdepapper av ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) med flera motparter (2)

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T18:41:07Z	<pre> <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>11223344556677889900</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN> FR00BH4HKS3</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">2000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty D	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	2000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

5.6.2 Återinvestering av kontantsäkerhet

415. Motparterna bör rapportera återinvestering av kontantsäkerhet när kontanter används som säkerhet i transaktioner för utlåning eller inlåning av värdepapper och återinvesteras antingen direkt av långivaren (säkerhetstagaren) eller av en agent på långivarens vägnar. Rapporteringen av återinvestering är oberoende av typen av finansiell motpart i fråga, t.ex. mäklare, handlare, investeringsföretag osv. Den är knuten till sin position i de relevanta transaktionerna för värdepappersfinansiering.

416. Typen av återinvestering (fält 4.12) och det återinvesterade kontantbeloppet (fält 4.13) bör specificeras enligt den valuta som använts för den återinvesterade kontantsäkerheten (fält 4.14). Eftersom motparterna förväntas rapportera en enda återinvesteringsgrad utan uppdelning efter valuta bör återinvesteringsgraden (fält 4.11) beräknas som ett viktat medelvärde på basis av det återinvesterade kontantbeloppet (fält 4.13) efter omräkning till valutan för de återinvesterade kontanterna (fält 4.14).
417. Sådana kontanter som erhållits som marginalsäkerhet i ej centralt clearade transaktioner för värdepappersfinansiering och sedan återinvesterats omfattas också av detta.
418. Kontanter som har erhållits från marginalutlåning och sedan återinvesterats bör inte rapporteras som återinvestering av kontantsäkerhet. Se avsnitt 5.3.16 om rapportering av kontantsäkerhet i samband med marginalutlåning.
419. Om den rapporterande motparten inte kan skilja mellan sina egna kontanter och kontanter mottagna som kontantsäkerhet bör beloppet för återinvestering av kontanter beräknas med samma metod som vid icke-kontantsäkerhet.
420. Kontantsäkerheter erhållna från centrala motparter (som en del av deras krav på marginalsäkerhet) och återinvesteringarna av kontantsäkerhet finns redan offentligt tillgängliga i de offentliga kvantitativa standarderna för offentliggörande av standardiseringsorganen CPMI-IOSCO¹⁹. Även om rapportering i enlighet med förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering sker på daglig basis (och inte på kvartalsbasis som vid de offentliga kvantitativa standarderna) är den jämförbar i fråga om detaljnivå och typ av insamlad information, och behöver inte kompletteras med tilläggsrapportering. Därför är centrala motparter återinvestering av kontantsäkerheter undantagna.
421. Slutligen bör motparterna vid rapportering av återinvestering av kontantsäkerhet även beakta eventuell senare vägledning eller förtydligande som FSB utfärdar i detta sammanhang.

5.6.2.1 Återinvestering av kontanter av ett finansiellt företag eller av ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) utan delegering av rapportering

422. Tabell 106 visar ett fall där motpart B rapporterar egen återinvestering av kontanter motsvarande 100 000 euro med en ränta på 1,5 procent på repomarknaden.

Tabell 106 – Återinvestering av kontanter av ett finansiellt företag eller av ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) utan delegering av rapportering			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd>
2	Event date	2020-04-23	

¹⁹ CPMI-IOSCO, februari 2015, "Public quantitative disclosure standards for central counterparties": <https://www.bis.org/cpmi/publ/d125.pdf>

Tabell 106 – Återinvestering av kontanter av ett finansiellt företag eller av ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) utan delegering av rapportering			
No	Field	Example	XML Message
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1.5	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh>
18	Action type	REUU	<CshRinvstmtRate>1.5</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

5.6.2.2 Återinvestering av kontanter av ett finansiellt företag eller av ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) med delegering av rapportering

423. Tabell 107 visar ett fall där motpart A delegerar rapporteringen av sin återinvestering av kontanter till motpart B. Motpart B rapporterar en återinvestering av kontanter på 100 000 euro med en ränta på 1 procent på repomarknaden.

Tabell 107 – Återinvestering av kontanter av ett finansiellt företag eller av ett icke-finansiellt företag (ej litet eller medelstort företag) med delegering av rapportering

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <CollReuseUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh>
18	Action type	REUU	<CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

5.6.2.3 Återinvestering av kontanter av ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) med en motpart

424. Tabell 108 visar ett fall där motpart C är ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) som har ingått transaktioner för värdepappersfinansiering med en enda enhet –

motpart B. Motpart B rapporterar en återinvestering av kontantsäkerhet på 100 000 euro med en ränta på 1 procent på repomarknaden.

Tabell 108 – Återinvestering av kontanter av ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) med en motpart			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> </RinvstdCsh> </Csh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} OF counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
11	Reinvestment Rate	1	
12	Type of re-invested cash investment	REPM	
13	Re-invested cash amount	100000	
14	Re-invested cash currency	EUR	
18	Action type	REUU	

5.6.2.4 Återinvestering av kontanter av ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) med flera motparter

425. Tabell 109 och Tabell 110 visar den information som små eller medelstora icke-finansiella företag bör rapportera vid återinvestering av säkerhet med flera motparter. I detta exempel finns det två tabeller. Det kan dock finnas lika många tabeller som motparter med vilka det lilla eller medelstora icke-finansiella företaget har ingått transaktioner för värdepappersfinansiering och sedan återinvesterat kontantsäkerheten.
426. I detta fall är motpart C ett litet eller medelstort icke-finansiellt företag som har ingått transaktioner för värdepappersfinansiering med två motparter – motpart B och motpart D. Motpart B rapporterar en återinvestering av kontantsäkerhet på 100 000 euro i Tabell 109. Motpart D rapporterar en återinvestering av kontantsäkerhet på 100 000 euro i Tabell 110.

Tabell 109 – Återinvestering av kontanter av ett litet eller medelstort icke-finansiellt företag med flera motparter (1)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> </Csh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
11	Reinvestment Rate	1	
12	Type of re-invested cash investment	REPM	
13	Re-invested cash amount	100000	
14	Re-invested cash currency	EUR	
18	Action type	REUU	

Tabell 109 – Återinvestering av kontanter av ett litet eller medelstort icke-finansiellt företag med flera motparter (1)

No	Field	Example	XML Message
			2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

Tabell 110 – Återinvestering av kontanter av ett litet eller medelstort icke-finansiellt företag med flera motparter (2)

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>
2	Event date	2020-04-23	<TradData> <Rpt> <CollReuseUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI2} of counterparty D	<LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>11223344556677889900</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh>
18	Action type	REUU	<RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt>

Tabell 110 – Återinvestering av kontanter av ett litet eller medelstort icke-finansiellt företag med flera motparter (2)

No	Field	Example	XML Message
			<pre> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>

5.6.3 Ingen återanvändning av icke-kontantsäkerhet eller återinvestering av kontanter

427. Tabell 111 illustrerar hur fälten bör fyllas i om varken återanvändning av icke-kontantsäkerhet eller återinvestering av kontantsäkerhet har ägt rum. Motparterna bör för detta ändamål rapportera på samma sätt som i Tabell 111.

428. I detta fall bör fält 12 i tabell 4 i de tekniska tillsynsstandarderna ("Typ av återinvesterad kontantinvestering") anges som "other" (annat).

Tabell 111 – Ingen återanvändning av kontantsäkerhet

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>
2	Event date	2020-04-23	<TradData> <Rpt> <CollReuseUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI2} of counterparty D	<LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	CASH	<LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	OTHR	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	0	<LEI>11223344556677889900</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>OTHR</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">0</RinvstdCshAmt>

Tabell 111 – Ingen återanvändning av kontantsäkerhet

No	Field	Example	XML Message
			<pre> </RinvstdCsh> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 _</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>

5.6.4 Finansieringskällor

429. Fälten om finansieringskällor bör endast rapporteras om det finns ett utestående marginallån eller marknadsvärde för korta positioner. De rapporterade motparterna eller de rapporteringsansvariga enheterna bör ange denna information på nivån av rapporterad motpart och inte på transaktionsnivå.
430. Tabell 112 visar ett fall där motpart B rapporterar ett belopp på 5 000 000 euro som finansieringskällor från repomarknaden för finansiering av marginallån.

Tabell 112 – Finansieringskällor

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn> <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
15	Funding sources	REPO	
16	Market value of the funding sources	5000000	
17	Funding sources currency	EUR	

Tabell 112 – Finansieringskällor			
No	Field	Example	XML Message
18	Action type	REUU	<pre> </CtrPtyData> <CollCmpnt> ... </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> <FndgSrc> <Tp>REPO</Tp> <MktVal Ccy="EUR">5000000</MktVal> </FndgSrc> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre>

6 Återkoppling om avvisning

431. I artikel 1.1 i de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter anges de olika kontroller som ett transaktionsregister bör genomföra för att säkerställa korrektheten och fullständigheten i de uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som rapporteras i enlighet med artikel 4 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.
432. Transaktionsregistret bör tillhandahålla återkoppling vid avvisning i enlighet med följande avvisningskategorier:
- Validering av databasschemat för inlämnad rapport i enlighet med artikel 1.1 b i de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter.
 - Godkännande/tillstånd av en rapportande enhet i enlighet med artikel 1.1 c de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter.
 - Logisk validering av inlämnad rapport i enlighet med artikel 1.1 d–j i de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter.
 - Handelsregler eller validering av innehåll i enlighet med artikel 1.1 k i de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter som ingår i valideringsreglerna och anges i dessa riktlinjer.
433. Observera att transaktionsregistret verifierar enheter vid tidpunkten för anslutning till transaktionsregistrets system; följaktligen anges ingen specifik återkoppling om avvisning.
434. Transaktionsregistret bör verifiera överensstämmelsen av filen med XML-databasschemat (syntax för hela filen och särskilda rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering). Om filen inte uppfyller kraven ska hela filen (samtliga transaktioner i filen) avvisas med motiveringen att filen är "korrump".

435. Enligt artikel 1 c i de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter ska denna kontroll ingå i verifieringen av rapporter till transaktionsregistret och så länge som tillståndsförhållandet kan fastställas vid anslutning ska även rapporteringsrätten kontrolleras på nivån av inlämnad rapport, och transaktionsregistret bör omedelbart avvisa de rapporter som inte klarar denna kontroll och tillhandahålla ett lämpligt återkopplingsmeddelande.
436. Transaktionsregistren bör använda det relevanta XML-meddelandet enligt ISO 20022 för att ge de enheter som är anslutna till detta transaktionsregister återkoppling om validering. Transaktionsregistren bör använda koderna i rapporteringsfälten när motparter underrättas om avvisning.
437. Efter mottagandet av avvisningen bör de rapporterade motparterna eller den rapporteringsansvariga motparten antingen direkt eller via en rapporterad enhet lämna in korrekta och fullständiga rapporter inom tidsfristen för rapportering enligt artikel 4.1 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.
438. Om filen innehåller tre transaktioner men transaktionerna inte klarar kontrollerna visar statistiken filen som godkänd med tre avisade transaktioner.
439. Om en datafil – som lämnats in av den rapporterade motparten, enheten som ansvarar för rapportering eller den rapportinlämnande enheten – innehåller ett allvarligt databasschemafel och transaktionerna inte kan kontrolleras, anges detta som avvisning av en fil.
440. Förutom den ovannämnda informationen ger transaktionsregister varje rapporterad motpart, rapporteringsansvarig enhet eller rapporterad enhet i tillämpliga fall en daglig slutrapport (auth. 084.001.01) som innehåller följande uppgifter:

Tabell 113 – Återkoppling om avvisning			
No.	Field	Details to be reported	XML Message
1	Number of files received	Numeric values	<pre> <SciesFincgRptgTxStsAdv> <TxRptStsAndRsn> <Rpt> <RptSttstcs> <TtlNbOfRpts>2</TtlNbOfRpts> </Rpt> </TxRptStsAndRsn> <TtlNbOfRptsAccptd>1</TtlNbOfRptsAccptd> <TtlNbOfRptsRjctd>1</TtlNbOfRptsRjctd> <NbOfRptsRjctdPerErr> <DtldNb>1</DtldNb> <RptSts> <MsgRptld>ReportID</MsgRptld> <Sts>RJCT</Sts> <DtldVldtnRule> <Id>RuleID</Id> <Desc>Rule description</Desc> <SchmeNm> <Cd>1</Cd> </SchmeNm> </pre>
2	No. of files accepted	Numeric values	
3	No. of files rejected	Numeric values	
4	File identification	Textual value	
5	Rejection reason	Error code	
6	Rejection description	Error description	
7	Number of SFTs received	Numeric values	
8	Number of SFTs accepted	Numeric values	
9	Number of SFT s rejected	Numeric values	
10	Identification of the SFT		
11	Reporting counterparty	Table A Field 3	
12	UTI	Table B Field 1	
13	Other counterparty	Table A Field 11	
14	Master agreement type	Table B Field 9	
15	Rejection reason	Error codes	
16	Rejection description	Error description	

		<pre> </DtldVldtnRule> </RptSts> </NbOfRptsRjctdPerErr> </RptSttstcs> <TxSttstcs> <TtlNbOfTxs>2</TtlNbOfTxs> <TtlNbOfTxsAccptd>1</TtlNbOfTxsAccptd> <TtlNbOfTxsRjctd>1</TtlNbOfTxsRjctd> <NbOfTxsRjctd> <TxId> <Tx> <RptgCtrPty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </OthrCtrPty> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <Vrsn>2019</Vrsn> </MstrAgrmt> </Tx> </TxId> <Sts>RJCT</Sts> <DtldVldtnRule> <Id>RuleID</Id> <Desc>Rule description</Desc> </DtldVldtnRule> </NbOfTxsRjctd> </TxSttstcs> </Rpt> </TxRptStsAndRsn> </SctiesFincgRptgTxStsAdv< </pre>
--	--	---

441. Detta säkerställer att den rapporterade motparten eller den rapporteringsansvariga enheten får en god uppfattning om sin efterlevnad av rapporteringsskyldigheten enligt förordningen även i fall där denna motpart eller enhet inte rapporterar direkt till transaktionsregistret utan enbart har ett visningsbart konto.

7 Återkoppling om avstämning

442. Under den registerövergripande avstämningsprocessen matchar transaktionsregistret olika lån och i) stämmer sedan av lånen i avstämningsfälten för lån samtidigt som det ii)

stämmer av säkerheten i avstämningsfält för säkerhet. Således matchas inte säkerheten, oavsett om det rör sig om en transaktionsbaserad säkerhet eller en nettoexponeringsbaserad säkerhet. Endast lån bör matchas; den säkerhet som avser lånen vid såväl transaktionsbaserad säkerhet som säkerhet på nettoexponeringsbasis kommer att stämmas av. Transaktionsregister bör inte matcha säkerheter. Om ena parten inte ställer någon nettoexponeringsbaserad säkerhet bör alla säkerhetstillgångar rapporteras i statusrapporten för avstämningsresultat under "Not Matched" (Ej matchad) och avstämningsstatusen för säkerheten anges som "Not Reconciled" (Ej avstämd).

Tabell 114 – Avstämningskategorier	
Reconciliation categories	Allowable values
Reporting type	Single-sided/dual-sided
Reporting requirement for both counterparties	Yes/No
Pairing Status	Paired/unpaired
Loan reconciliation status	Reconciled/not reconciled
Collateral reconciliation status	Reconciled/not reconciled
Further modifications:	Yes/No

443. Efter mottagandet och godkännandet av ett meddelande med åtgärdstypen "EROR" som följer efter kontrollen, bör transaktionsregistret stryka respektive transaktion för värdepappersfinansiering från avstämningen med omedelbar verkan, dvs. från och med den närmast följande avstämningstiden.
444. Vidare kan ingen transaktion för värdepappersfinansiering återaktiveras. Därför bör en transaktion för värdepappersfinansiering undantas från avstämning 30 dagar efter förfallodagen eller det förtida avslutet av transaktionen, dvs. vid rapportering med åtgärdstypen "Avslut/Förtida avslut" eller "Positionskomponent" i enlighet med villkoren i artikel 2.2 h i de tekniska tillsynsstandarderna för kontroll av uppgifter. Vid avstämning av olika uppgifter om säkerheten skiljer sig dessa meddelanden från lånemeddelanden i och med att de saknar förfallodagar. Vid nettoexponeringsbaserad säkerhet innebär detta att datumet är knutet till datumet för lånesidan av transaktionen för värdepappersfinansiering. Därför bör ett transaktionsregister sträva efter avstämning av dessa uppgifter fram till 30 dagar efter avslutandet eller förfallodagen av det senaste lån som ingår i säkerheten på nettoexponeringsbasis. Dessutom upprepas säkerhetens avstämningsstatus vid en säkerhet på nettoexponeringsbasis för alla transaktioner för värdepappersfinansiering som ingår i denna säkerhet på nettoexponeringsbasis.
445. Om båda motparter omfattas av rapporteringskravet bör de säkerställa att de rapporterade transaktionerna för värdepappersfinansiering har matchningsstatusen "matchad" (paired), låneavstämningsstatus "avstämd" (reconciled) och säkerhetsavstämningsstatus "avstämd" (reconciled).
446. För att underlätta detta kommer transaktionsregister att tillhandahålla följande rapport med detaljerad information om avstämningsstatusen för varje transaktion för värdepappersfinansiering som de har rapporterat och som omfattas av avstämning:

Tabell 115 – Återkoppling om avstämning				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
1	Reporting counterparty	Unique key	Table A Field 3	<SciesFincgRptgRcncltnStsAdv <RcncltnData> <Rpt> <PaigrRcncltnSts>
2	UTI		Table B Field 1	
3	Other counterparty		Table A Field 11	
4	Master agreement type		Table B Field 9	
	Report status		Paired/Reconciled	<DtldNbOfRpts>2</DtldNbOfRpts> <DtldSts>PARD</DtldSts> </PaigrRcncltnSts> <RcncltnRpt>
	Reporting timestamp	Information on the last reporting timestamp pertaining to the SFT that is reconciled	Table A Field 1	... <Txld> <RptgCtrPty> <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
	Modification status	Information if the transaction subject of reconciliation was modified	True/False	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN </LEI> </OthrCtrPty> <UnqTradldr>UT110</UnqTradldr> </Txld> <Modfd>>true</Modfd> <RcncltnSts> <RptgData> <NotMtchd> <CtrPty1>
	No Reconciliation required	Indication that the transaction is not subject of reconciliation	True/False	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CtrPty1>
	Matching status		True/False	<CtrPty2>
	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	<LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE</LEI> </CtrPty2>
	Reportable loan fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported	Loan fields of Table 1 of RTS on data verification	<MtchgCrit> <LnMtchgCrit> <TermntnDt> <Val1>2019-04-20 <Val2>2019-04-21 </TermntnDt> </LnMtchgCrit>
	Collateral reconciliation status		reconciled/not reconciled	<CollMtchgCrit> <CmpntTp> <Scty>

Tabell 115 – Återkoppling om avstämning				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
	Reportable collateral fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported	Collateral fields of Table 1 of RTS on data verification	<pre> <Qty> <Val1>1234</Val1> <Val2>1243</Val2> </Qty> </Scty> </CmpntTp> </CollMtchgCrit> </MtchgCrit> </NotMtchd> </RptgData> </RcncltnSts> </RcncltnRpt> </Rpt> </RcncltnData> </SctiesFincgRptgRcncltnStsAdv> </pre>

447. Efter borttagning av transaktioner för värdepappersfinansiering från avstämning bör dessa transaktioner även avlägnas från de avstämningsrapporter som utfärdas till motparter och myndigheter. Transaktionsregistret bör lagra den senaste avstämningsstatusen för dessa transaktioner för värdepappersfinansiering i sina system.

8 Utebliven återkoppling om säkerhet

448. Det bör anges huruvida transaktionen för värdepappersfinansiering har säkerhet eller inte. Om transaktionen för värdepappersfinansiering har säkerhet bör informationen om säkerheten tillhandahållas så snart den blir känd.
449. Om informationen om säkerheten är okänd vid rapporteringstidpunkten fylls vissa uppgifter om säkerheten, dvs. fält 2.75–2.94, inte i. I stället anges antingen en giltig ISIN-kod för korgen av säkerheter eller "NTAV" i fält 2.96. Rapporten om transaktion för värdepappersfinansiering accepteras.
450. Vid dagens slut bör transaktionsregistret enligt artikel 3.c i de tekniska tillsynsstandarderna för insamling av uppgifter generera en rapport som innehåller "den unika transaktionsidentifieraren för de transaktioner för värdepappersfinansiering där fält 72 i tabell 2 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2019/363 innehåller uppgiften "felaktig", och för vilka information om säkerheter i fälten 73–96 i samma tabell ännu inte har rapporterats". Med tanke på att informationen om individuella säkerhetskomponenter anges i fält 2.75–2.94 bör transaktionsregistret generera en "Rapport om utebliven säkerhet" för att påminna enheter om inlämnande av vissa uppgifter om säkerheten; rapporten bör innehålla UTI-koder för de transaktioner för värdepappersfinansiering som motparten har rapporterat som säkrade men för vilka endast fält 2.96 har fyllts i.
451. Med utgångspunkt i förväntningen att ingen säkerhet tilldelas intradagstransaktioner för värdepappersfinansiering bör transaktionsregister inkludera de transaktioner för

värdepappersfinansiering som uppfyller alla villkor enligt nedan i rapporten för att säkerställa effektiviteten och användbarheten av uppgifterna för motparterna:

- a. Transaktioner för värdepappersfinansiering där "felaktig" anges i fält 2.72 och där endast fält 2.96 har fyllts i.
- b. Transaktioner för värdepappersfinansiering där datumdelen av genomförandetillfället och förfallodagen eller datumet för avslutande skiljer sig åt.
- c. Transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av avstämning.

9 Inlämnande av information till myndigheter

9.1 Tidsfrister för tillhandahållande av tillgång till uppgifter

452. För att tillhandahålla tillgång till uppgifter i tid bör transaktionsregister planera sina interna processer på ett sådant sätt att en myndighet har direkt och omedelbar tillgång till uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering senast 30 dagar efter inlämnandet av begäran om tillgång, i enlighet med artikel 4.1 f.
453. Transaktionsregister bör använda informationen från myndigheterna i relevant form i enlighet med de tekniska tillsynsstandarderna för tillgång till uppgifter. Även filialers och dotterbolags uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering bör tillhandahållas myndigheter med beaktande av befintliga uppgifter om LEI-förhållanden.
454. Vidare gäller att vid beviljande av tillgång till uppgifter rapporterade av motparter i enlighet med artikel 4 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering bör transaktionsregistren ta med transaktioner för värdepappersfinansiering rapporterade på transaktions- och positionsnivå i aktivitets- och statusfiler.
455. När det gäller kraven enligt artikel 4.2 k i de tekniska tillsynsstandarderna om tillgång till uppgifter bör åtkomst beviljas i fråga om råvaror om de relevanta medlemsstaterna för dessa kan identifieras.
456. När det gäller kraven enligt artikel 4.2 n i de tekniska tillsynsstandarderna om tillgång till uppgifter bör tillgången till uppgifter omfatta alla icke-värderingsfält där valutan emitterad av centralbanken används om åtkomst till transaktioner för värdepappersfinansiering i denna valuta ska beviljas. Om samma valuta emitteras av flera myndigheter (som är fallet med valutan euro) ska samtliga dessa myndigheter ha tillgång till dessa transaktioner för värdepappersfinansiering.
457. När det gäller kraven i artikel 4.2 o i de tekniska tillsynsstandarderna bör transaktionsregistret säkra mottagande av information som intygar relevanta administratörers behörighet i fråga om riktmärken, om åtkomst ska beviljas till transaktioner för värdepappersfinansiering med riktmärken tillhandahållna av en administratör för vilken enheten har mandat enligt artikel 12.2 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering.

9.2 Operativa arrangemang för tillgång till uppgifter

458. När det gäller detaljerna för transaktioner för värdepappersfinansiering rapporterade enligt tabellerna 1–4 i bilagan till de tekniska tillsynsstandarderna för rapportering, bl.a. senaste transaktionsstatusar för transaktioner för värdepappersfinansiering som inte har löpt ut eller varit föremål för rapporter med åtgärdsstyper "Fel", "Avslut/förtida avslut" eller "Positionskomponent" i enlighet med fält 98 i tabell 2 i bilaga I till de tekniska genomförandestandarderna för rapportering, bör transaktionsregistren använda följande XML-mallar.
459. De relevanta meddelandena om handelsaktivitet är auth.052.001.01 (motpart, lån och säkerhet), auth.070.001.01 (marginalsäkerhet), auth.071.001.01 (återanvändning av säkerhet). De relevanta statusmeddelandena är 079.001.01 (motpart, lån och säkerhet), auth.085.001.01 (marginalsäkerhet), auth.086.001.01 (återanvändning av säkerhet). Dessa mallar har uppdaterats och förtydligats för i) rapportering av reposäkerhet och säkerhet för köp- och återförsäljningstransaktioner, ii) rapportering av säkerhet vid marginalutlåning, iii) rapportering av säkerhet på nettoexponeringsbasis, iv) flera tillgångar som säkerhet.
460. Vidare bör samma mallar användas när transaktionsregister upprättar svar på såväl upprepade som ad hoc-förfrågningar om uppgifter om lån och säkerheter. Transaktionsregister är inte skyldiga att bevilja tillgång till uppgifter om marginalsäkerheter och återanvändning vid ad hoc-förfrågningar eftersom de två rapporterna saknar fält som möjliggör förfrågningar.

Tabell 116 – Rapport om transaktion för värdepappersfinansiering – uppgifter om motpart, lån och säkerhet			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 1 Field 1 to Field 18 Table 2 Field 1 to Field 99	<pre> <SciesFincgRptgTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> </pre>

Tabell 116 – Rapport om transaktion för värdepappersfinansiering – uppgifter om motpart, lån och säkerhet

No.	Field	Details to be reported	XML schema
			... </SciesFincgRptgTxStatRpt>

461. Dessutom rapporterar motparter, rapporteringsansvariga enheter eller rapportinlämnande enheter uppgifter om marginalsäkerhet och återanvändning på nivån av utgången av uppgifter. Detta hindrar inte att en rapporterande motpart, rapporteringsansvarig enhet eller rapportinlämnande enhet rapporterar denna information i flera delar.
462. Transaktionsregistret bör i aktivitetsrapporten auth.070.001.01 (marginalsäkerhet) tillhandahålla myndigheter alla rapporter om marginalsäkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering som inlämnades en viss dag och i statusrapporten auth.085.001.01 den senaste statusen för alla marginalsäkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering som rapporterades för det relevanta händelsedatumet alternativt den senaste rapporterade informationen om ingen information rapporterades för datumet i fråga.

Tabell 117 – Rapport om transaktion för värdepappersfinansiering – uppgifter om marginalsäkerheter– Rapport om transaktion för värdepappersfinansiering – uppgifter om marginalsäkerheter

No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 3 Field 1 to Field 20	<SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPty> ... </CtrPty> <CollPrftlId>...</CollPrftlId> <PstdMrgnOrColl> ... </PstdMrgnOrColl> <RcvdMrgnOrColl> ... </RcvdMrgnOrColl> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt>

463. När transaktionsregistret beviljar tillgång till uppgifter om återanvändning avseende ett icke-finansiellt företag (litet eller medelstort företag) bör det tillhandahålla myndigheterna alla uppgifter rapporterade med åtgärdsstyper "NEWT" och "REUU" för den rapporterade motparten och det angivna händelsedatumet. Transaktionsregistret bör använda fälten "Enhet som ansvarar för rapportering" och "Rapportinlämnande enhet" för att fastställa tillämpliga fall. Om det finns flera rapporteringsansvariga enheter för en viss rapporterad motpart och alla dessa använder samma rapportinlämnande enhet bör transaktionsregistret tillhandahålla alla rapporter om återanvändning av säkerhet för detta händelsedatum som inlämnades för den rapporterade motparten.
464. I aktivitetsrapporten auth.071.001.01 bör transaktionsregistret tillhandahålla myndigheterna alla rapporter om återanvändning av säkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering som inlämnades en viss dag, och i statusrapporten auth.086.001.01 bör transaktionsregistret ange den senaste statusen för alla rapporter om återanvändning av säkerheter av transaktioner för värdepappersfinansiering som rapporterades för det relevanta händelsedatumet alternativt den senaste rapporterade informationen om ingen information rapporterades för datumet i fråga.

Tabell 118 – Rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering – uppgifter om återanvändning

No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 4 Field 1 to Field 18	<pre> <SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <CollCmpnt> ... </CollCmpnt> ... <FndgSrc> ... </FndgSrc> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt> </pre>

465. När det gäller relevanta detaljer av rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering som aviseras av transaktionsregistret, bl.a. eventuella rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering avisade under den föregående

arbetsdagen och skäl till avvisandet i enlighet med tabell 2 i bilaga I till de tekniska tillsynsstandarderna för kontroll av uppgifter, bör transaktionsregister använda samma XML-mall som i Tabell 113 – Återkoppling om avvisning.

Tabell 119 – Rapportering av avvisning				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
1	Number of files received		Numeric values	
2	No. of files accepted		Numeric values	
3	No. of files rejected		Numeric values	
4	File identification		Textual value	
5	Rejection reason		Error code	
6	Rejection description		Error description	
7	Number of SFT received		Numeric values	
8	No. of SFT accepted		Numeric values	
9	No. of SFT s rejected		Numeric values	
10	Identification of the SFT			
11	Reporting counterparty	Unique key of the SFT	Table 1 Field 3	
12	UTI		Table 2 Field 1	
13	Other counterparty		Table 1 Field 11	
14	Master agreement type		Table 2 Field 9	
15	Rejection reason		Error codes	
16	Rejection description		Error description	

466. När det gäller avstämningsstatusen för alla rapporterade transaktioner för värdepappersfinansiering för vilka transaktionsregistret har genomfört avstämningsprocessen i enlighet med de tekniska tillsynsstandarderna för kontroll av uppgifter (utom de transaktioner för värdepappersfinansiering som har löpt ut eller för vilka rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "Fel", "Avslut/förtida avslut" eller "Positionskomponent" erhölls minst än en månad innan datumet för avstämningsprocessen) bör transaktionsregistret använda samma XML-mall som i Tabell 115 – Återkoppling om avstämning.
467. XSD har uppdaterats för att tillhandahålla avstämningsvärden för flera säkerhetslement för båda motparter, den rapporteringsansvariga enheten, den rapportinlämnande enheten och myndigheter.
468. Resultaten av säkerhetsavstämningen bör rapporteras en enda gång för alla transaktioner som omfattas av samma ramavtalstyp, och säkerhetens nettoexponering angetts som "sant" (true).

Tabell 120 – Statusrapport för avstämning av transaktioner för värdepappersfinansiering				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
1	Reporting counterparty	Unique key	Table 1 Field 3	
2	UTI		Table 2 Field 1	

Tabell 120 – Statusrapport för avstämning av transaktioner för värdepappersfinansiering				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
3	Other counterparty		Table 1 Field 11	
4	Master agreement type		Table 2 Field 9	
5	Report status		Paired/Reconciled	
6	Reporting timestamp	Information on the last reporting timestamp pertaining to the SFT that is reconciled	Table 1 Field 1	
7	Modification status	Information if the transaction subject of reconciliation was modified	True/False	
8	No Reconciliation required	Indication that the transaction is not subject of reconciliation	True/False	
9	Matching status		True/False	
10	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	
11	Reportable loan fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported		
12	Collateral reconciliation status		reconciled/not reconciled	
13	Reportable collateral fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported		

469. För varje mottagen förfrågan bör transaktionsregister kontrollera om förfrågningen är korrekt och kan hanteras i deras system. Vid ogiltiga uppgiftsförfrågningar (sådana som inte uppfyller kraven) skickar transaktionsregistret ett återkopplingsmeddelande till myndigheten med information om att förfrågningen är ogiltig och en beskrivning av feltypen.

```
<FinInstrmRptgStsAdv<
  <MsgStsAdv<
    <MsgSts>
      <RptSts>RJCT</RptSts>
      <VldtnRule>
        <Id>EXE-003</Id>
        <Desc>Description of the rule</Desc>
      </VldtnRule>
      <RefDt>2017-11-15T10:35:55Z</RefDt>
    </MsgSts>
  </MsgStsAdv<
</FinInstrmRptgStsAdv<
```

470. Transaktionsregistret ska hantera ad hoc-förfrågningar snarast möjligt efter inlämnandet och kontrollen, även på icke-arbetsdagar. Tidsfristen för besvarande av ad hoc-förfrågningar anges i artikel 5.4 i de tekniska tillsynsstandarderna för tillgång till uppgifter:
- Om en begäran om tillgång till uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering avser utestående transaktioner där löptiden har passerat eller där rapportering med åtgärdstyperna "Fel", "Avslutande/tidigt avslutande" eller "Positionskomponent" enligt fält 98 i tabell 2 i bilaga I till de tekniska genomförandestandarderna för rapportering har skett högst ett år före den dag då begäran lämnades in: senast klockan 12:00 koordinerad universell tid den första kalenderdagen efter den dag då begäran om tillgång lämnades in.
 - Om en begäran om tillgång till uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering avser utestående transaktioner där löptiden har passerat eller där rapportering med åtgärdstyperna "Fel", "Avslutande/tidigt avslutande" eller "Positionskomponent" enligt fält 98 i tabell 2 i bilaga I till de tekniska genomförandestandarderna för rapportering har skett mer än ett år före den dag då begäran lämnades in: senast tre arbetsdagar efter det att begäran om tillgång lämnades in.
 - Om begäran om tillgång avser både uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som omfattas av led a och sådana som omfattas av led b: senast tre arbetsdagar efter det att begäran om tillgång lämnades in.
471. Om inlämnandet av begäran om tillgång till uppgifter görs mindre än en dag före den första genomförandedagen kan det första genomförandet skjutas upp till den påföljande genomförandedagen i enlighet med de parametrar som anges förfrågningen.

472. Om genomförandet av en förfrågan misslyckas av tekniska skäl ska transaktionsregistret skicka ett felmeddelande till Esmas system. Felmeddelandet bör beskriva typen av fel.
473. Som svar på varje uppgiftsbegäran upprättar transaktionsregistret en svarsfil som innehåller uppgifter om alla transaktioner för värdepappersfinansiering som uppfyller de sökkriterier som anges av myndigheten:
- För en ad-hoc-begäran upprättas en engångssvarsfil (en svarsfil per begäran).
 - För en upprepad begäran upprättas regelbundna svarsfiler med den frekvens som anges av myndigheten.
474. Transaktionsregister bör tillåta att enheter som omfattas av artikel 12.2 i förordningen om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering fastställer en annan frekvens än "dagligen" för datatillgången. Vid fastställande av en maximal tidsfrist för hantering av en upprepad begäran bör transaktionsregister ta hänsyn till enheters behov enligt artikel 12.2 i förordningen och begränsa riskerna för deras system och dess korrekta funktion.
475. I artikel 5 i de tekniska tillsynsstandarderna för tillgång till uppgifter hänvisas det inte till de tidsscheman som transaktionsregister bör följa vid schemalagt underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter, oavsett vilken kanal eller vilket format som används.
476. Transaktionsregister bör noggrant planera sitt schemalagda underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter, så att det inte sammanfaller med arbetsdagar enligt en överenskommen EU-omfattande kalender såsom Target2-kalendern. Om det i undantagsfall sammanfaller med en sådan arbetsdag bör schemalagt underhåll utföras utanför normal arbetstid, dvs. mycket tidigt på morgonen eller mycket sent på kvällen. Transaktionsregister bör tillse att det ovannämnda schemalagda underhållet inte utförs på ett sådant sätt att det hindrar myndigheters tillgång till uppgifter om derivat i tid.
477. Transaktionsregister bör använda elektroniska medel för att underrätta alla myndigheter om start- och slutdatum och -tid för genomförande av schemalagt underhåll.
478. Om transaktionsregistret tillämpar årlig planering av tider för schemalagt underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter kan transaktionsregistret årligen underrätta alla myndigheter om planeringen minst tre arbetsdagar i förväg. Eventuella ytterligare specifika meddelanden om schemalagt underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter förutom årliga meddelanden bör skickas snarast möjligt, dock minst tre arbetsdagar före startdatumet för det schemalagda underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter.
479. Transaktionsregister bör föra ett register över relevanta meddelanden som vid begäran kan tillhandahållas Esmas. Register över meddelanden om schemalagt underhåll bör åtminstone innehålla följande information: meddelandets tidsstämpel, start- och sluttid för det schemalagda underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter och den relevanta listan av användare som underrättats.
480. Vid kontroll av förfrågningar enligt artikel 5.5 i de tekniska tillsynsstandarderna för tillgång till uppgifter bör transaktionsregister bekräfta mottagandet av åtkomstförfrågningen och

kontrollera att den är korrekt och fullständig snarast möjligt, dock senast 60 minuter efter avslutandet av det relevanta schemalagda underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter.

481. Vid tillgång till uppgifter i enlighet med led a i artikel 5.4 i de tekniska tillsynsstandarderna för tillgång till uppgifter bör transaktionsregister sträva efter att besvara förfrågningen snarast möjligt, dock senast kl. 12.00 (UTC) den första kalenderdagen som följer efter dagen för avslutandet av det schemalagda underhåll som påverkar transaktionsregistrets tjänster med avseende på myndigheters tillgång till uppgifter. Tidsscheman enligt led b och c i artikel 5.4 påverkas inte.
482. Vid icke schemalagt underhåll bör transaktionsregister hålla de tider som föreskrivs i artikel 5.4 och 5.5 i tillsynsstandarderna för tillgång till uppgifter; dessa tidsfrister används som utgångspunkt vid bedömning av transaktionsregistrets regelefterlevnad. Transaktionsregister bör underrätta Esmå om eventuellt icke schemalagt underhåll i enlighet med sina förfaranden.
483. De utgående filerna upprättas av transaktionsregister i XML-format enligt ISO 20022. De utgående filerna bör innehålla en delmängd uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering begränsad av myndighetens mandat enligt artikel 1 och artikel 2 i de tekniska tillsynsstandarderna för tillgång till uppgifter.
484. De utgående filerna bör innehålla undergruppen av transaktionsdata enligt de kriterier som anges i förfrågan. Om svaret på en förfrågan innehåller ett stort antal poster bör det delas upp i många filer.
485. För varje transaktion bör den utgående filen inkludera samtliga fält angivna i de tekniska tillsynsstandarderna och de tekniska genomförandestandarderna som motparterna har rapporterat till transaktionsregister. Kriterierna för dataförfrågningar bör endast begränsa antalet parametrar (fält som är öppna för förfrågningar) och följaktligen antalet poster i den utgående filen, dock inte omfattningen av den tillhandahållna informationen per transaktion (dvs. antalet fält per transaktion).
486. Om förfrågan inte ger några transaktioner som resultat bör transaktionsregistret skicka ett svarsmeddelande om detta.