

KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) 2019/358**af 13. december 2018****om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2015/2365 for så vidt reguleringsmæssige tekniske standarder for transaktionsregistres indsamling, verifikation, aggregering, sammenligning og offentliggørelse af data om værdipapirfinansieringstransaktioner****(EØS-relevant tekst)**

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2015/2365 af 25. november 2015 om gennemsigtighed af værdipapirfinansieringstransaktioner og vedrørende genanvendelse samt om ændring af forordning (EU) nr. 648/2012 ⁽¹⁾, særlig artikel 5, stk. 7, litra a), og artikel 12, stk. 3, litra a) og b), og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) For at sikre, at de oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner, der indberettes til transaktionsregistre, er af høj kvalitet, bør transaktionsregistre verificere de indberettende enheders identitet, logikken i den rækkefølge, hvori oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner indberettes, og om de pågældende oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner er fuldstændige og korrekte.
- (2) Af samme grund bør transaktionsregistre afstemme oplysningerne i alle de indberetninger af værdipapirfinansieringstransaktioner, som de modtager. Der bør fastsættes en standardprocedure for at gøre det muligt for transaktionsregistre at foretage afstemninger på en konsekvent måde og for at begrænse risikoen for, at oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner ikke afstemmes. Det er dog muligt, at visse oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner ikke er identiske på grund af særlige egenskaber ved de teknologsystemer, som enhederne anvender til indberetning. Det er derfor nødvendigt at anvende visse tolerancer, således at mindre forskelle mellem de indberettede oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner ikke forhindrer myndighederne i at analysere dataene med tilstrækkelig konfidens.
- (3) Indberettende enheder må forventes at forbedre deres indberetninger med tiden, hvilket både burde give sig udtryk i en nedgang i antallet af afviste indberetninger og i flere afstemte indberetninger. De indberettende enheder bør dog gives tilstrækkelig tid til at tilpasse sig indberetningskravene, navnlig for at forhindre en ophobning af ikke-afstemte transaktioner umiddelbart efter, at indberetningskravet er taget i anvendelse. Derfor bør kun en begrænset række felter afstemmes i første omgang.
- (4) Indberettende enheder og enheder, som er ansvarlige for indberetning, hvis sådanne findes, bør kunne overvåge, om de opfylder deres indberetningsforpligtelser i henhold til forordning (EU) 2015/2365. De bør derfor dagligt kunne få adgang til visse oplysninger om de pågældende indberetninger, herunder resultatet af verifikationen af de pågældende indberetninger, samt status for afstemningen af de indberettede data. Det er derfor nødvendigt at præcisere, hvilke oplysninger transaktionsregistre bør give disse enheder adgang til ved slutningen af hver arbejdsdag.
- (5) For at fremme integriteten af oplysningerne om værdipapirfinansieringstransaktioner bør den direkte og øjeblikkelige adgang, der er omhandlet i artikel 12, stk. 2, i forordning (EU) 2015/2365, gives på en harmoniseret og konsekvent måde. For at standardisere indberetningen, minimere branchens omkostninger og sikre sammenlignelighed og konsekvent aggregering af data på tværs af transaktionsregistre bør samtlige outputrapporter og udvekslinger leveres i skemaer i XML-format og følge en metode, som er almindeligt anvendt i finansverdenen.
- (6) Adgang til positionsdata for eksponeringer mellem to givne modparter er en forudsætning for, at de enheder, der er omhandlet i artikel 12, stk. 2, i forordning (EU) 2015/2365, kan identificere potentielle kilder til systemiske eller ikke-systemiske risici for den finansielle stabilitet.
- (7) For at sikre offentligheden en tilstrækkelig grad af gennemsigtighed med hensyn til værdipapirfinansieringstransaktioner bør de kriterier, som anvendes til aggregering af positioner gøre det muligt for den brede offentlighed at forstå, hvordan markeder for værdipapirfinansieringstransaktioner fungerer, uden at det går ud over

⁽¹⁾ EUT L 337 af 23.12.2015, s. 1.

fortroligheden af de data, som indberettes til transaktionsregistre. Hyppigheden af og indholdet i transaktionsregistrenes offentliggørelse af aggregerede positioner i henhold til artikel 12, stk. 1, i forordning (EU) 2015/2365 bør præciseres på grundlag af den dertil relaterede ramme i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 ⁽²⁾ om derivataftaler.

- (8) Denne forordning er baseret på det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) har forelagt Kommissionen i overensstemmelse med proceduren i artikel 10 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 ⁽³⁾.
- (9) Bestemmelserne i denne forordning omhandler operationelle standarder for transaktionsregistres indsamling, aggregering og sammenligning af data samt de procedurer, som transaktionsregistre skal anvende for at verificere, at de oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner, der indberettes til dem, er fuldstændige og korrekte.. Af hensyn til sammenhængen mellem de pågældende bestemmelser, og for at transaktionsregistre lettere kan få et samlet overblik, er det hensigtsmæssigt at samle de dertil knyttede reguleringsmæssige tekniske standarder i én enkelt forordning.
- (10) ESMA har afholdt åbne offentlige høringer om disse udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, analyseret de potentielle omkostninger og fordele og anmodet ESMA's interessentgruppe for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i forordning (EU) nr. 1095/2010, om en udtalelse —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Transaktionsregistres verifikation af indberetninger af værdipapirfinansieringstransaktioner

1. Transaktionsregistre skal verificere følgende oplysninger i indberetninger af værdipapirfinansieringstransaktioner, som de har modtaget:
- a) den indberettende enheds identitet, jf. felt 2 i tabel 1 i bilag I til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2019/363 ⁽⁴⁾
 - b) at det XML-skema, der er anvendt til at indberette en værdipapirfinansieringstransaktion, er i overensstemmelse med ISO 20022-metoden, jf. gennemførelsesforordning (EU) 2019/363
 - c) at den indberettende enhed, hvis den adskiller sig fra den indberettende modpart, jf. felt 3 i tabel 1 i bilag I til [gennemførelsesforordning (EU) 2019/363, har behørig beføjelse til at indberette på den indberettende modparts vegne, jf. dog den situation, som er omhandlet i artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365
 - d) at den samme indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner ikke er indgivet tidligere
 - e) at en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner af handlingstypen »Modification« (ændring) vedrører en tidligere indgivet indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner
 - f) at en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner af handlingstypen »Modification« (ændring) ikke vedrører en værdipapirfinansieringstransaktion, der er indberettet som annulleret
 - g) at indberetningen af værdipapirfinansieringstransaktioner ikke omfatter handlingstypen »New« (ny), hvis den vedrører en værdipapirfinansieringstransaktion, der allerede er indberettet
 - h) at indberetningen af værdipapirfinansieringstransaktioner ikke omfatter handlingstypen »Position component« (positionskomponent), hvis den vedrører en værdipapirfinansieringstransaktion, der allerede er indberettet

⁽²⁾ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre (EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1).

⁽³⁾ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/77/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84).

⁽⁴⁾ Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2019/363 af 13. december 2018 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for formatet for og hyppigheden af indberetninger til transaktionsregistre i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2015/2365 af nærmere oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner og om ændring af Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 for så vidt angår anvendelsen af indberetningskoder i forbindelse med indberetning af derivataftaler (se side 85 i denne EUT).

- i) at indberetningen af værdipapirfinansieringstransaktioner ikke har til formål at ændre oplysningerne om den indberettende enhed, den indberettende modpart eller den anden modpart til en tidligere indberettet værdipapirfinansieringstransaktion
 - j) at indberetningen af værdipapirfinansieringstransaktioner ikke har til formål at ændre en eksisterende indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner ved at angive en valørdato efter den indberettede værdipapirfinansieringstransaktions udløbsdato
 - k) at indberetningen af værdipapirfinansieringstransaktioner er korrekt og fuldstændig.
2. Transaktionsregistre skal verificere, om der er indberettet oplysninger om sikkerhedsstillelse i felt 73-96 i tabel 2 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363 for værdipapirfinansieringstransaktioner, når felt 72 »SL-signalisering af udlån i værdipapirer uden sikkerhedsstillelse« i den samme tabel er indberettet som »False« (fejlagtig). Transaktionsregistre skal i overensstemmelse med denne forordnings artikel 3 underrette den indberettende enhed og den indberettende modpart samt den enhed, der er ansvarlig for indberetning, hvis en sådan findes, om resultatet af verifikationen.
3. Transaktionsregistre skal afvise en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, som ikke opfylder et af kravene i stk. 1, og angive den i en af de afvisningskategorier, der er omhandlet i tabel 2 i bilag I til denne forordning.
4. Transaktionsregistre skal give den indberettende enhed og den indberettende modpart samt den enhed, der er ansvarlig for indberetning, hvis en sådan findes, nærmere oplysninger om resultaterne af den verifikation af data, der er omhandlet i stk. 1, i løbet af 60 minutter, efter at de har modtaget en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner. Transaktionsregistre skal indgive disse resultater i XML-format i et skema, som er udformet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden. Resultaterne skal, hvis det er relevant, omfatte de særlige grunde til at afvise en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner i overensstemmelse med stk. 3.

Artikel 2

Transaktionsregistres afstemning af data

1. Transaktionsregistre skal tilsligte at foretage en afstemning af indberettede værdipapirfinansieringstransaktioner ved at træffe de foranstaltninger, der er omhandlet i stk. 2, forudsat at følgende betingelser er opfyldt:
- a) transaktionsregistret har afsluttet de verifikationer, der er omhandlet i artikel 1, stk. 1 og 2
 - b) begge modparter i den indberettede værdipapirfinansieringstransaktion er indberetningspligtige
 - c) transaktionsregistret har ikke modtaget en efterfølgende indberetning af handlingstypen »Error« (fej) vedrørende den indberettede værdipapirfinansieringstransaktion.
2. Hvis alle betingelserne i stk. 1 er opfyldt, træffer transaktionsregistret følgende foranstaltninger og anvender den senest indberettede værdi for hvert af felterne i tabel 1 i bilag I til denne forordning:
- a) transaktionsregistre, som har modtaget en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, skal verificere, om de har modtaget en tilsvarende indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner fra eller på vegne af den anden modpart
 - b) transaktionsregistre, som ikke har modtaget en tilsvarende indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, jf. litra a), skal bestræbe sig på at identificere det transaktionsregister, som har modtaget den tilsvarende indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, ved at underrette alle registrerede transaktionsregistre om værdierne i følgende felter vedrørende den indberettede værdipapirfinansieringstransaktion: »entydig transaktionsidentifikator«, »indberettende modpart«, »anden modpart« og »masteraftaletype«
 - c) transaktionsregistre, som konstaterer, at et andet transaktionsregister har modtaget en tilsvarende indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, jf. litra a), skal udveksle oplysningerne om den indberettede værdipapirfinansieringstransaktion med nævnte transaktionsregister i XML-format i et skema, som er udformet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden
 - d) transaktionsregistre skal med forbehold af litra e) behandle en indberettet værdipapirfinansieringstransaktion som afstemt, hvis oplysningerne om nævnte værdipapirfinansieringstransaktion svarer til oplysningerne i den tilsvarende indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, jf. litra a)
 - e) transaktionsregistre skal tilsligte særskilt at matche de felter, der vedrører lånedata, og de felter, der vedrører data om sikkerhedsstillelse, for en indberettet værdipapirfinansieringstransaktion i overensstemmelse med de tolerancegrænser og relevante anvendelsesdatoer, der er omhandlet i tabel 1 i bilag I til denne forordning

- f) transaktionsregistre skal derefter angive værdier for afstemningskategorierne for de enkelte indberettede værdipapirfinansieringstransaktioner, jf. tabel 3 i bilag I til denne forordning
 - g) transaktionsregistre skal afslutte de foranstaltninger, der er omhandlet i litra a)-f) hurtigst muligt, og må ikke træffe sådanne foranstaltninger efter kl. 18:00 UTC på en given arbejdsdag
 - h) transaktionsregistre, som ikke kan foretage en afstemning af en indberettet værdipapirfinansieringstransaktion, skal tilsigte at matche oplysningerne om nævnte indberettede værdipapirfinansieringstransaktion den følgende arbejdsdag. Transaktionsregistre skal ikke længere tilsigte at foretage en afstemning af den indberettede værdipapirfinansieringstransaktion 30 dage efter den indberettede værdipapirfinansieringstransaktions udløb, eller efter at transaktionsregistret har modtaget en indberetning vedrørende værdipapirfinansieringstransaktionen af handlingstypen »Termination« (afslutning) eller »Position component« (positionskomponent).
3. Transaktionsregistre skal ved slutningen af hver arbejdsdag bekræfte det samlede antal afstemte, indberettede værdipapirfinansieringstransaktioner over for hvert af de transaktionsregistre, som de har afstemt indberettede værdipapirfinansieringstransaktioner med.
4. Transaktionsregistre skal senest 60 minutter efter afslutningen af den afstemningsproces, der er omhandlet i stk. 2, litra g), underrette den indberettende enhed og den indberettende modpart samt den enhed, der er ansvarlig for indberetning, hvis en sådan findes, om resultaterne af den afstemningsproces, de har foretaget af de indberettede værdipapirfinansieringstransaktioner. Transaktionsregistre skal indgive disse resultater i XML-format i et skema, som er udformet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden, samt oplysninger om de felter, der ikke er afstemt.

Artikel 3

Mekanismer til underretning ved dagens slutning

Transaktionsregistre skal ved slutningen af hver arbejdsdag give den indberettende enhed og den indberettende modpart samt den enhed, der er ansvarlig for indberetning, hvis en sådan findes, adgang til følgende oplysninger om de relevante værdipapirfinansieringstransaktioner i XML-format i et skema, som er udformet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden:

- a) de værdipapirfinansieringstransaktioner, der er indberettet i løbet af den pågældende dag
- b) den seneste handel med de værdipapirfinansieringstransaktioner, der ikke er udløbet, eller som ikke har været genstand for en indberetning af handlingstypen »Error« (fejl), »Termination« (afslutning) eller »Position component« (positionskomponent)
- c) de entydige transaktionsidentifikatorer (UTTer) for de værdipapirfinansieringstransaktioner, for hvilke felt 72 i tabel 2 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363 er indberettet som »False« (fejlagte), og der endnu ikke er indberettet oplysninger om sikkerhedsstillelsen i felt 73-96 i den samme tabel
- d) de indberetninger af værdipapirfinansieringstransaktioner, der er afvist i løbet af den pågældende dag
- e) afstemningsstatus for alle indberettede værdipapirfinansieringstransaktioner, undtagen de værdipapirfinansieringstransaktioner, som er udløbet, eller som har været genstand for indberetninger af værdipapirfinansieringstransaktioner af handlingstypen »Termination« (afslutning) eller »Position component« (positionskomponent), der blev modtaget mere end en måned før den pågældende arbejdsdag.

Artikel 4

Adgang til oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner

Transaktionsregistre skal give de enheder, der er opført i artikel 12, stk. 2, i forordning (EU) 2015/2365, direkte og øjeblikkelig adgang, også i forbindelse med delegation i henhold til artikel 28 i forordning (EU) nr. 1095/2010, til oplysningerne om værdipapirfinansieringstransaktioner i elektronisk og maskinlæsbart format, jf. Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/357 ⁽³⁾.

Transaktionsregistre skal med henblik på første afsnit anvende et XML-format og et skema, der er udviklet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden.

⁽³⁾ Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/357 af 13. december 2018 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2015/2365 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for adgang til oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner, der opbevares i transaktionsregistre (se side 22 i denne EUT).

Artikel 5

Beregning af og adgang til positionsdata

1. Transaktionsregistre skal beregne positionsdata for eksponeringer mellem modparter i forhold til lån og sikkerhedsstillelse. Beregningen af positionsdata baseres på følgende kriterier:
 - a) værdierne for afstemningskategorier, jf. tabel 3 i bilag I til denne forordning
 - b) type værdipapirfinansieringstransaktion
 - c) modparternes sektor
 - d) clearingstatus
 - e) i eller uden for handelsplads
 - f) type sikkerhedsstillelse
 - g) kontantdelens valuta
 - h) løbetidskurv
 - i) haircut-kurv
 - j) de transaktionsregistre, som den anden modpart indberettede oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner til.
2. Transaktionsregistre skal sikre, at de enheder, der er opført i artikel 12, stk. 2, i forordning (EU) 2015/2365, har adgang til positionsdata i overensstemmelse med den adgang til data, der er omhandlet i delegeret forordning (EU) 2019/357.
3. De positionsdata, der er omhandlet i stk. 1, gives i elektronisk og maskinlæsbart XML-format og i et skema, der er udviklet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden.
4. Den adgang, der er omhandlet i stk. 2, gives hurtigst muligt og senest på den arbejdsdag, der følger efter modtagelsen af en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner i overensstemmelse med artikel 4, stk. 1, i forordning (EU) 2015/2365.
5. Transaktionsregistre giver de enheder, der er opført i artikel 12, stk. 2, i forordning (EU) 2015/2365, adgang til aggregerede data i overensstemmelse med den adgang til data, der er omhandlet i delegeret forordning (EU) 2019/357, og beregnet i overensstemmelse med i fællesskab vedtagne standarder og processer for global indsamling og aggregering af data om værdipapirfinansieringstransaktioner.

Artikel 6

Beregning af aggregerede positionsdata til offentliggørelse

1. Transaktionsregistre skal aggregere positionsdata på grundlag af de kriterier, der er omhandlet i stk. 2 og 3, for følgende værdier:
 - a) det nominelle beløb for genkøbsaftaler, buy/sell-back-transaktioner eller sell/buy-back-transaktioner, den samlede mængde af ud- eller indlån af værdipapirer eller råvarer og margenlånenes størrelse
 - b) antal UTI-koder svarende til de relevante værdipapirfinansieringstransaktioner
 - c) sikkerhedsstillelsens markedsværdi.
2. Transaktionsregistre skal aggregere positionsdata for samtlige indberettede værdipapirfinansieringstransaktioner af handlingstypen »New« (ny) i tidsrummet mellem lørdag kl. 00:00:00 UTC og fredag kl. 23:59:59 UTC på grundlag af følgende kriterier og de dertil knyttede værdier i tabel 1 i bilag II til denne forordning:
 - a) den indberettende modparts eller, hvis det er relevant, den relevante filials beliggenhed
 - b) den anden modparts eller, hvis det er relevant, den relevante filials beliggenhed
 - c) type værdipapirfinansieringstransaktion
 - d) værdipapirfinansieringstransaktionens status i afstemningsprocessen, jf. tabel 3 i bilag I til denne forordning

- e) den type handelsplads, hvor værdipapirfinansieringstransaktionen blev indgået
 - f) hvorvidt værdipapirfinansieringstransaktionen er clearret eller ikke
 - g) den metode, hvormed sikkerhedsstillelsen er overført
 - h) hvert indeks, der anvendes som reference i forbindelse med en værdipapirfinansieringstransaktion, der er handlet på et andet handelssted end »XXXX«, når det aggregerede nominelle beløb, der er indberettet til handelsregistret i indekset, er større end 5 milliarder EUR, og når mindst seks forskellige modparter har indberettet de relevante værdipapirfinansieringstransaktioner til handelsregistret.
3. Transaktionsregistre skal aggregere positionsdata for samtlige værdipapirfinansieringstransaktioner, som ikke er udløbet, og for hvilke der ikke er modtaget indberetninger af handlingstypen »Error« (fejl), »Termination« (afslutning) eller »Position component« (positionskomponent), senest fredag kl. 23:59:59 UTC på grundlag af følgende kriterier og de dertil knyttede værdier i tabel 1 i bilag II til denne forordning:
- a) den indberettende modparts eller, hvis det er relevant, den relevante filials beliggenhed
 - b) den anden modparts eller, hvis det er relevant, den relevante filials beliggenhed
 - c) type værdipapirfinansieringstransaktion
 - d) værdipapirfinansieringstransaktionens status i afstemningsprocessen, jf. tabel 3 i bilag I til denne forordning
 - e) den type handelsplads, hvor værdipapirfinansieringstransaktionen blev indgået
 - f) hvorvidt værdipapirfinansieringstransaktionen er clearret eller ikke
 - g) den metode, hvormed sikkerhedsstillelsen er overført
 - h) hvert indeks, der anvendes som reference i forbindelse med en værdipapirfinansieringstransaktion, der er handlet på et andet handelssted end »XXXX«, når det aggregerede nominelle beløb, der er indberettet til handelsregistret i indekset, er større end 5 milliarder EUR, og mindst seks forskellige modparter har indberettet de relevante værdipapirfinansieringstransaktioner til handelsregistret.
4. Transaktionsregistre skal råde over en procedure til identificering af ekstraordinære værdier blandt de aggregerede positionsdata.
5. Transaktionsregistre skal råde over en procedure til gennemførelse af og underretning om korrektioner af de aggregerede data, herunder dem, der stammer fra indberetninger af handlingstypen »Error« (fejl), og til offentliggørelse af de oprindelige og de korrigerede dataaggregeringer.

Artikel 7

Offentliggørelse af aggregerede positionsdata

1. Transaktionsregistre skal på deres websted offentliggøre aggregerede positionsdata, beregnet i overensstemmelse med artikel 6, på ugebasis og senest tirsdag middag for værdipapirfinansieringstransaktioner indberettet senest kl. 23:59:59 UTC den foregående fredag.
2. Transaktionsregistre skal offentliggøre samtlige aggregerede positionsdata i euro og anvende de vekselkurser, som blev offentliggjort på ECB's websted fredagen før offentliggørelsen af de pågældende data.
3. Transaktionsregistre skal sikre, at de aggregerede positionsdata offentliggøres i en tabel som anført i bilag II til denne forordning, der gør det muligt at downloade dataene.
4. De aggregerede positionsdata, som et transaktionsregister har offentliggjort på sit websted, skal forblive på det pågældende websted i mindst 104 uger.

Artikel 8

Ikrafttræden

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Den er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 13. december 2018.

På Kommissionens vegne

Jean-Claude JUNCKER

Formand

BILAG I

Tabel 1

Afstemningsfelter, toleranceniveauer og afstemningsfasens startdato

Tabel	Afsnit	Felt	Tolerance	Startdato anført i:
Modpartsdata	Ikke relevant	Indberettende modpart	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Modpartsdata	Ikke relevant	Modpartsside	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Modpartsdata	Ikke relevant	Anden modpart	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Entydig transaktionsidentifikator (UTI)	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Type værdipapirfinansierings-transaktion	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Clearet	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Tidsstempel for clearing	1 time	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Central modpart	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Handelsplads	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Type masteraftale	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Tidsstempel for gennemførelse	1 time	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Valørdato (Startdato)	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Udløbsdato (Slutdato)	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Afviklingsdato	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Minimumsfrist for opsigelse	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Første mulige dato for call-back	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Indikator for generel sikkerhedsstillelse	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder

Tabel	Afsnit	Felt	Tolerance	Startdato anført i:
Transaktionsdata	Lån	DBV-indikator (DBV = Delivery By Value)	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Metode anvendt til at stille sikkerhed	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Uden fastsat løbetid	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Afviklingsmulighed	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Fast rente	Til tre decimaler	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Konvention for beregning af dage	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Variabel rente	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Referenceperiode for variabel rente — tidsperiode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Referenceperiode for variabel rente — multiplikator	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Betalingshyppighed for variabel rente — tidsperiode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Betalingshyppighed for variabel rente — multiplikator	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rente — tidsperiode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rente — multiplikator	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Spænd	Til tre decimaler	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Margenlåns valutabeløb	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Margenlåns valuta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365

Tabel	Afsnit	Felt	Tolerance	Startdato anført i:
Transaktionsdata	Lån	Justeret rente	Til tre decimaler	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Rentedato	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Nominelt beløb på valørdato	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Nominelt beløb på udløbsdato	0,0005 %	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Nominelt beløbs valuta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Aktivtype	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Identifikator for værdipapir	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Værdipapirsklassifikation	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Basisprodukt	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Underprodukt	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Yderligere underprodukt	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Kvantitet eller nominelt beløb	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Måleenhed	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Nominelt beløbs valuta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Værdipapirkurs eller råvarepris	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Prisvaluta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Værdipapirets kvalitet	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Værdipapirets løbetid	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365

Tabel	Afsnit	Felt	Tolerance	Startdato anført i:
Transaktionsdata	Lån	Udstederens jurisdiktion	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Udstederens LEI-kode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Værdipapirtype	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Lånebeløb	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Markedsværdi	0,0005 %	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Fast rabat	Til tre decimaler	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Variabel rabat	Til tre decimaler	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Referenceperiode for variabel rabat — tidsperiode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Referenceperiode for variabel rabat — multiplikator	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Betalingshyppighed for variabel rabat — tidsperiode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Variabelt rabatbeløb — multiplikator	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rabat — tidsperiode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rabat — multiplikator	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Rabatspænd	Til tre decimaler	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Vederlag	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365

Tabel	Afsnit	Felt	Tolerance	Startdato anført i:
Transaktionsdata	Lån	Eksklusivaftaler	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Lån	Udestående margenlån	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Udestående margenlåns basisvaluta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Markedsværdi på kort sigt	0,0005 %	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	SL-signalisering af udlån i værdipapirer uden sikkerhedsstillelse	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Sikkerhedsstillelse for netteeksponering	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Sikkerhedsstillelsens valørdato	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Type sikkerhedsstillelseskomponent	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Kontant sikkerhedsstillelsesbeløb	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Kontant sikkerhedsstillelses valuta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Identifikation af et værdipapir stillet som sikkerhed	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Klassifikation af et værdipapir stillet som sikkerhed	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Basisprodukt	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Underprodukt	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Yderligere underprodukt	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. iv), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Sikkerhedsstillelsens kvantitet eller nominelle beløb	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Måleenhed for sikkerhedsstillelse	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder

Tabel	Afsnit	Felt	Tolerance	Startdato anført i:
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Sikkerhedsstillelsens nominelle beløbs valuta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Prisvaluta	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Pris pr. enhed	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Sikkerhedsstillelsens markedsværdi	0,0005 %	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365 + 24 måneder
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Haircut eller margen	Til tre decimaler	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Sikkerhedsstillelsens kvalitet	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Værdipapirets udløbsdato	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Udstederens jurisdiktion	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Udstederens LEI-kode	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Type sikkerhedsstillelse	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Mulighed for genanvendelse af sikkerhedsstillelse	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Sikkerhedsstillelse	Identifikator for sikkerhedsstillelseskurs	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365
Transaktionsdata	Lån	Niveau	Ingen	Artikel 33, stk. 2, litra a), nr. i), i forordning (EU) 2015/2365

Tabel 2

Grunde til afvisning af en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner

Afvisningskategorier	Grund
Skema	— værdipapirfinansieringstransaktionen er afvist, fordi skemaet ikke opfylder de stillede krav
Tilladelse	— værdipapirfinansieringstransaktionen er afvist, fordi den indberettende enhed ikke har tilladelse til at indberette på den indberettende modparts vegne
Logik	— værdipapirfinansieringstransaktionen er afvist, fordi handlingstypen for værdipapirfinansieringstransaktionen ikke er logisk
Forretningskik	— værdipapirfinansieringstransaktionen er afvist, fordi den på et eller flere punkter ikke opfylder bestemmelserne om validering

Tabel 3

Resultater af afstemningsprocessen

Afstemningskategorier	Afstemningsværdier
Indberetningstype	Enkeltsidet/dobbeltsidet
Indberetningskrav for begge modparter	Ja/Nej
Status for match	Match/ikke-match
Lån — status i afstemningsproces	Afstemt/ikke-afstemt
Sikkerhedsstillelse — status i afstemningsproces	Afstemt/ikke-afstemt
Yderligere ændringer	Ja/Nej

BILAG II

Tabel 1

Offentlige data

Tabel A. Aggregering

Dato	TR	Type aggregering	Type handelsplads	Indberettende modparts beliggenhed	Anden modparts beliggenhed	Afstemning	Type værdipapirfinansieringstransaktion	Clearet	Metode til overførsel af sikkerhedsstillelse	Indeks anvendt som reference ⁽¹⁾	Aggregeret udlånsbeløb	Aggregeret antal transaktioner	Sikkerhedsstillelsens aggregerede værdi
20161007	EU TR	Indberettet	XXXX	EØS	EØS	Dobbeltsidet, lån afstemt, sikkerhedsstillelse ikke afstemt	Repo	Ja	TTCA		...		...
...	...	Udestående	XOFF	Ikke-EØS	Ikke-EØS	Dobbeltsidet, lån afstemt, sikkerhedsstillelse afstemt	BSB/SBB	Nej	SICA		...		...
...	...	...	EØS MIC	...	...	Enkeltsidet EØF, lån afstemt, sikkerhedsstillelse afstemt	Ud- og indlån i værdipapirer eller råvarer	...	SIUR		...		...
...	...	...	Ikke-EØS MIC	...	...	...	Margenlån	...			...		...
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...	...

⁽¹⁾ Udfyldes med de relevante indekser i felt 25 i tabel 2 »Oplysninger om lån og sikkerhedsstillelse« i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363