

KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) 2022/1858**af 10. juni 2022**

om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder til præcisering af procedurerne for afstemning af data mellem transaktionsregistre og de procedurer, som transaktionsregistret skal anvende for at kontrollere, at den indberettende modpart eller den indberettende enhed opfylder indberetningskravene, og for at kontrollere, at de indberettede data er fuldstændige og korrekte

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre ⁽¹⁾, særlig artikel 78, stk. 10, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) For at sikre, at de oplysninger om derivater, der indberettes til transaktionsregistre, er af høj kvalitet, bør transaktionsregistre kontrollere de indberettende enheders identitet, logikken i den rækkefølge, hvori oplysninger om derivatet indberettes, og om de pågældende oplysninger om derivatet er fuldstændige og korrekte.
- (2) Af samme grund bør transaktionsregistre afstemme oplysningerne i alle de modtagne indberetninger af derivater, hvor begge modparter har en indberetningspligt. 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 derivater ikke afstemmes. Det er dog muligt, at visse oplysninger om derivater ikke er identiske på grund af særlige egenskaber ved de teknologisystemer, som enhederne anvender til indberetning. Det er derfor nødvendigt at anvende visse tolerancer, således at mindre forskelle mellem de indberettede oplysninger om derivater ikke forhindrer myndighederne i at analysere dataene med tilstrækkelig konfidens.
- (3) Desuden og uanset andre forpligtelser med hensyn til de nærmere oplysninger om derivater, der indsamles og registreres i forbindelse med afstemningsprocessen, bør transaktionsregistre sikre fortroligheden af de data, der udveksles mellem dem og stilles til rådighed for de indberettende modparter, de enheder, der er ansvarlige for indberetningen, og de indberettende enheder.
- (4) Hvis en virksomhedsomstruktureringshændelse, der medfører ændring af en modparts identifikator for juridiske enheder (»LEI«), finder sted, skal oplysningerne om de enheder, der er identificeret i en derivatindberetning, ajourføres. For at sikre integriteten af disse oplysninger, som er afgørende for overvågningen af systemiske risici for den finansielle stabilitet, er det nødvendigt, at ajourføringen foretages centralt af transaktionsregistre. Af den grund bør der indføres en procedure for at sikre, at transaktionsregistre kan ajourføre enhedens identifikator centralt, således at der sikres en effektiv, robust og rettidig proces.
- (5) 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 indberetningspligten er taget i anvendelse. Derfor bør kun en begrænset række felter afstemmes i første omgang.

⁽¹⁾ EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1.

- (6) Indberettende enheder og enheder, som er ansvarlige for indberetning, alt efter hvad der er relevant, bør kunne overvåge, om de opfylder deres indberetningspligter i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012. De bør derfor dagligt kunne få adgang til visse oplysninger om de pågældende indberetninger, herunder resultatet af kontrollen af de pågældende indberetninger, også hvorvidt der er genereret en advarsel samt afstemningsstatus for de indberettede data. Det er derfor nødvendigt at præcisere, hvilke oplysninger transaktionsregistre bør give disse enheder adgang til ved hver arbejdsdags afslutning.
- (7) Denne forordning er baseret på det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) har forelagt for Kommissionen.
- (8) Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed har hørt medlemmerne af Det Europæiske System af Centralbanker og har afholdt åbne offentlige høringer om det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som ligger til grund for denne forordning, analyseret de potentielle omkostninger og fordele samt anmodet interessegruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010, om rådgivning ⁽²⁾.
- (9) For at gøre det muligt for modparter og transaktionsregistre at træffe alle nødvendige foranstaltninger med henblik på at tilpasse sig de nye krav bør datoen for denne forordnings anvendelse udskydes med 18 måneder —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Transaktionsregistres verifikation af derivater

1. Transaktionsregistre skal verificere følgende oplysninger i indberetninger af derivater, som de har modtaget:
 - a) identiteten af den indberettende enhed, jf. felt 2 i tabel 1 og felt 2 i tabel 3 i bilaget til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860 ⁽³⁾
 - b) at det XML-skema, der anvendes til at indberette et derivat, er i overensstemmelse med ISO 20022-metoden i overensstemmelse med artikel 1 i gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860
 - c) at den indberettende enhed, hvis den er forskellig fra den enhed, der er ansvarlig for indberetningen, jf. felt 3 i tabel 1 og felt 3 i tabel 3 i bilaget til gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860, er behørigt bemyndiget til at indberette på vegne af modpart 1 eller den enhed, der er ansvarlig for indberetningen, hvis den er forskellig fra modpart 1, jf. felt 4 i tabel 1 og felt 4 i tabel 3 i bilaget til gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860
 - d) at den samme indberetning af derivatet ikke er indgivet tidligere
 - e) at en indberetning af derivater med handlingstypen »Ændring«, »Ajourføring af margin«, »Værdiansættelse«, »Korrektion«, »Fejl« eller »Afvikling« vedrører et tidligere indberettet derivat
 - f) at en derivatindberetning med handlingstypen »Ændring« ikke vedrører et derivat, der er indberettet som annulleret med handlingstypen »Fejl«, som ikke efterfølgende er blevet indberettet med handlingstypen »Genåbning«
 - g) at indberetningen af et derivat ikke omfatter handlingstypen »Ny«, hvis den vedrører et derivat, der allerede er indberettet

⁽²⁾ 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).

⁽³⁾ Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860 af 10. juni 2022 om fastlæggelse af gennemførelsesmæssige tekniske standarder for anvendelsen af Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 for så vidt angår standarder, formater, hyppighed og metoder og ordninger i forbindelse med indberetning (se side 68 i denne EUT).

- h) at indberetningen af et derivat ikke omfatter handlingstypen »Positionskomponent«, hvis den vedrører et derivat, der allerede er indberettet
 - i) at en indberetning af derivater ikke har til formål at ændre oplysningerne i felterne »Modpart 1« eller »Modpart 2« i et tidligere indberettet derivat
 - j) at indberetningen af et derivat ikke har til formål at ændre en eksisterende indberetning af et derivat ved at angive en ikrafttrædelsesdato efter det indberettede derivats udløbsdato
 - k) at et derivat, der er indberettet med handlingstypen »Genåbning«, vedrører en tidligere indgivet indberetning af derivater med handlingstypen »Fejl« eller »Afvikling« eller et derivat, der er udløbet
 - l) at indberetningen af derivater er korrekt og fuldstændig.
2. Transaktionsregistre skal afvise en indberetning af derivater, som ikke opfylder et af kravene i stk. 1, og angive den i en af de afvisningskategorier, der er omhandlet i tabel 1 i bilaget.
3. Transaktionsregistre giver de indberettende enheder nærmere oplysninger om resultaterne af den kontrol af data, der er omhandlet i stk. 1, senest 60 minutter efter at de har modtaget en indberetning af derivatet. Transaktionsregistre skal give disse resultater i XML-format i et skema i overensstemmelse med ISO 20022-metoden. I resultaterne angives begrundelserne for afvisningen af en derivatindberetning i overensstemmelse med tabel 1 i bilaget.

Artikel 2

Procedure for ajourføring af identifikatorer for juridiske enheder

1. Et transaktionsregister, der modtager en anmodning i henhold til artikel 8 i gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860, skal identificere de udestående derivater, der er omhandlet i artikel 2, stk. 2, i gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860 på tidspunktet for virksomhedsomstrukturingshændelsen, hvor enheden indberettes med den identifikator, der blev anvendt før virksomhedsomstrukturingshændelsen, i feltet »Modpart 1« eller »modpart 2« som oplyst i den relevante anmodning. Den erstatter den gamle identifikator med den nye identifikator for juridiske enheder (»LEI«) i indberetningerne vedrørende alle disse derivater på tidspunktet for den begivenhed, der er omhandlet i artikel 8 i gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860, og som vedrører den pågældende modpart. Transaktionsregistre skal gennemføre proceduren for ajourføring af identifikatoren senest på dagen for omstruktureringen eller senest 30 kalenderdage efter modtagelsen af anmodningen, hvis denne indberettes mindre end 30 kalenderdage før datoen for virksomhedsomstrukturingshændelsen.
2. Transaktionsregistre skal identificere de relevante derivater, der er omhandlet i artikel 2, stk. 2, i gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860 på tidspunktet for virksomhedsomstrukturingshændelsen, hvis enheden er identificeret med den gamle identifikator i et af felterne, og erstatte denne identifikator med den nye LEI. Hvis en virksomhedsomstrukturingshændelse vedrører en ajourføring af LEI-koden for andre felter end »Modpart 1« eller »Modpart 2«, foretager transaktionsregistret kun en sådan ajourføring af de relevante derivater efter rettidig bekræftelse fra modpart 1 eller den enhed, der er ansvarlig for indberetningen.
3. Et transaktionsregister varetager følgende opgaver:
- a) efter modtagelsen af den relevante bekræftelse i henhold til stk. 2 gennemføre ajourføringen af LEI-koden fra den dato, der er omhandlet i stk. 1
 - b) hurtigst muligt og senest 5 arbejdsdage efter modtagelsen af den fuldstændige underretning sende følgende oplysninger til alle de øvrige transaktionsregistre og til de indberettende modparter, indberettende enheder, enheder med ansvar for indberetning, der er involveret i de derivataftaler, der er berørt af ajourføringen af LEI-koder, og til tredjeparter, der har fået adgang til oplysninger i henhold til artikel 78, stk. 7, i forordning (EU) nr. 648/2012, alt efter hvad der er relevant:
 - i) de(n) gamle identifikator(er)
 - ii) den nye identifikator
 - iii) den dato, fra hvilken ajourføringen skal foretages
 - iv) i tilfælde af virksomhedshændelser, der påvirker en del af de derivater, der er udestående på datoen for hændelsen, listen over de unikke handelsidentifikatorer (UTI-koder) for de derivater, der er berørt af ajourføringen af LEI-koderne

- c) senest arbejdsdagen før den dato, hvor ajourføringen anvendes, underrette de enheder, der er opført i artikel 81, stk. 3, i forordning (EU) nr. 648/2012 og har adgang til de data vedrørende derivater, der er blevet ajourført, ved hjælp af en specifik fil i et maskinlæsbart format om:
- i) de(n) gamle identifikator(er)
 - ii) den nye identifikator
 - iii) den dato, fra hvilken ajourføringen skal foretages
 - iv) listen over de UTI-koder for de derivater, der er berørt af ajourføringen af LEI-koderne, i tilfælde af virksomhedshændelser, der påvirker en del af de derivater, der er udestående på datoen for hændelsen,
- d) registrere ajourføringen af LEI-koden i indberetningsloggen.
4. Transaktionsregistre må ikke ajourføre de LEI'er, der er indberettet for derivater, som er forskellige fra dem, der er omhandlet i artikel 2, stk. 2, i gennemførelsesforordning (EU) 2022/1860 på tidspunktet for virksomhedshændelsen.

Artikel 3

Transaktionsregistres afstemning af data

1. Transaktionsregistre skal tilslige at foretage en afstemning af indberettede derivater ved at træffe de foranstaltninger, der er omhandlet i stk. 3, forudsat at følgende betingelser er opfyldt:
- a) transaktionsregistret har afsluttet den kontrol, der er omhandlet i artikel 1, stk. 1 og 2
 - b) begge modparter i det indberettede derivat har en indberetningspligt i henhold til artikel 9 i forordning (EU) nr. 648/2012
 - c) transaktionsregistret har ikke modtaget en indberetning med handlingstypen »Fejl« for det indberettede derivat, medmindre en sådan indberetning er blevet fulgt op af en indberetning af handlingstypen »Genåbn«.
2. Transaktionsregistre skal have indført ordninger, der sikrer fortroligheden af dataene, når de udveksler oplysninger med andre transaktionsregistre, og når de indberetter oplysninger til indberettende modparter, indberettende enheder, enheder med ansvar for indberetning samt tredjeparter, der har fået adgang til oplysninger i henhold til artikel 78, stk. 7, i forordning (EU) nr. 648/2012, om værdierne for alle de felter, der er genstand for afstemning.
3. Hvis alle betingelserne i stk. 1 er opfyldt, træffer transaktionsregistret følgende foranstaltninger og anvender den senest indberettede værdi fra den foregående arbejdsdag for hvert af felterne i tabel 2 i bilaget:
- a) transaktionsregistre, som har modtaget en indberetning af derivater, skal verificere, om de har modtaget en tilsvarende indberetning fra eller på vegne af den anden modpart
 - b) transaktionsregistre, som ikke har modtaget en tilsvarende indberetning af derivater, jf. litra a), skal bestræbe sig på at identificere det transaktionsregister, som har modtaget den tilsvarende indberetning af derivater, ved at underrette alle registrerede transaktionsregistre om værdierne i følgende felter vedrørende det indberettede derivat: »Entydig transaktionsidentifikator«, »Modpart 1« og »Modpart 2«
 - c) transaktionsregistre, som konstaterer, at et andet transaktionsregister har modtaget en tilsvarende indberetning af derivater, jf. litra a), skal udveksle oplysningerne om det indberettede derivat med nævnte transaktionsregister i XML-format i et skema, som er udformet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden

- d) transaktionsregistre skal behandle et indberettet derivat som afstemt, hvis de nærmere oplysninger om det pågældende derivat, der er genstand for afstemning, stemmer overens med oplysningerne om det tilsvarende derivat som omhandlet i litra a) og i overensstemmelse med de gældende tolerancegrænser og relevante anvendelsesdatoer, jf. tabel 2 i bilaget
- e) transaktionsregistre skal derefter angive værdier for afstemningskategorierne for de enkelte indberettede derivattransaktioner, jf. tabel 3 i bilaget til denne forordning
- f) transaktionsregistre skal afslutte de foranstaltninger, der er omhandlet i litra a)-e), hurtigst muligt og må ikke træffe sådanne foranstaltninger efter midnat UTC (koordineret verdenstid) på en given arbejdsdag
- g) transaktionsregistre, som ikke kan foretage en afstemning af et indberettet derivat, skal tilsigte at matche oplysningerne om nævnte indberettede derivat den følgende arbejdsdag. Transaktionsregistret skal ikke længere søge at afstemme det indberettede derivat tredive kalenderdage efter, at derivatet ikke længere er udestående.

4. Transaktionsregistre skal ved slutningen af hver arbejdsdag bekræfte det samlede antal derivater, der matcher, og antallet af afstemte derivater over for hvert af de transaktionsregistre, som de har afstemt derivater med. Transaktionsregistre skal have indført skriftlige procedurer til at sikre løsningen af alle uoverensstemmelser, der konstateres i denne proces.

5. Transaktionsregistre skal senest 60 minutter efter afslutningen af den afstemningsproces, der er omhandlet i stk. 3, litra f), underrette de indberettende enheder om resultaterne af den afstemningsproces, de har foretaget af de indberettede derivater. Transaktionsregistre skal indgive disse resultater i XML-format i et skema, som er udformet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden, herunder også oplysninger om de felter, der ikke er afstemt.

Artikel 4

Mekanismer til underretning ved dagens slutning

1. For hver arbejdsdag stiller et transaktionsregister følgende oplysninger om de pågældende derivater til rådighed for de indberettende modparter, indberettende enheder, enheder med ansvar for indberetning samt tredjeparter, der har fået adgang til oplysninger i henhold til artikel 78, stk. 7, i forordning (EU) nr. 648/2012, alt efter hvad der er relevant, i et XML-format og et skema, der er udarbejdet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden:

- a) de derivater, der er indberettet i løbet af den pågældende dag
- b) de seneste handelsstadier for de udestående derivater
- c) de indberetninger af derivater, der er afvist i løbet af den pågældende dag
- d) afstemningsstatus for alle indberettede derivater, der er omfattet af afstemning i henhold til artikel 3, stk. 1
- e) de udestående derivater, for hvilke der ikke er indberettet nogen værdiansættelse, eller for hvilke den indberettede værdiansættelse er dateret mere end 14 kalenderdage før den dag, for hvilken indberetningen udarbejdes
- f) de udestående derivater, for hvilke der ikke er indberettet marginoplysninger, eller for hvilke de indberettede marginoplysninger er dateret mere end 14 kalenderdage før den dag, for hvilken indberetningen udarbejdes
- g) de derivater, der blev modtaget den pågældende dag med handlingstypen »Ny«, »Positionskomponent«, »Ændring« eller »Korrektion«, og hvis notionelle værdi er unormal for den pågældende derivatklasse.

2. Transaktionsregistre skal fremlægge sådanne oplysninger senest kl. 06:00 UTC på den arbejdsdag, der følger efter den dag, som oplysningerne i stk. 1 vedrører.

*Artikel 5***Ikrafttrædelse og anvendelse**

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

Den anvendes fra den 29. april 2024.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 10. juni 2022.

På Kommissionens vegne
Ursula VON DER LEYEN
Formand

BILAG

Tabel 1

Begrundelser for afvisning af en indberetning af et derivat

Afvisningskategorier	Begrundelse
Skema	— derivatet er afvist, fordi skemaet ikke opfylder de stillede krav
Tilladelse	— derivatet er afvist, fordi den indberettende enhed ikke har tilladelse til at indberette på vegne af den indberettende modpart eller den enhed, der er ansvarlig for indberetningen.
Logik	— derivatet er afvist, fordi handlingstypen for derivatet ikke er logisk
Virksomhed	— derivatet er afvist, fordi det på et eller flere punkter ikke opfylder en eller flere indholdsvalideringer.

Tabel 2

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
1	Derivatets parter	Tidsstempel for indberetningen	Ikke relevant	Ikke relevant
2	Derivatets parter	ID for indberettende enhed	Ikke relevant	Ikke relevant
3	Derivatets parter	Enhed med ansvar for indberetningen	Ikke relevant	Ikke relevant
4	Derivatets parter	Modpart 1 (Indberettende modpart)	Det samme som felt 9 i denne tabel	Startdato for indberetningspligten
5	Derivatets parter	Arten af modpart 1	Ikke relevant	Ikke relevant
6	Derivatets parter	Virksomhedssektor for modpart 1	Ikke relevant	Ikke relevant
7	Derivatets parter	Clearinggrænseværdi for modpart 1	Ikke relevant	Ikke relevant
8	Derivatets parter	Type identifikator for modpart 2	Ikke relevant	Ikke relevant
9	Derivatets parter	Modpart 2	Det samme som felt 4 i denne tabel	Startdato for indberetningspligten
10	Derivatets parter	Det pågældende land for modpart 2	Ikke relevant	Ikke relevant
11	Derivatets parter	Arten af modpart 2	Ikke relevant	Ikke relevant

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
12	Derivatets parter	Virksomhedssektor for modpart 2	Ikke relevant	Ikke relevant
13	Derivatets parter	Clearinggrænseværdi for modpart 2	Ikke relevant	Ikke relevant
14	Derivatets parter	Indberetningsforpligtelse for modpart 2	Ikke relevant	Ikke relevant
15	Derivatets parter	Mægler-ID	Ikke relevant	Ikke relevant
16	Derivatets parter	Clearingmedlem	Ikke relevant	Ikke relevant
17	Derivatets parter	Retning	Modsat retning	Startdato for indberetningspligten
18	Derivatets parter	Retning af første ben	Modsat retning	Startdato for indberetningspligten
19	Derivatets parter	Retning af andet ben	Modsat retning	Startdato for indberetningspligten
20	Derivatets parter	Direkte tilknyttet forretningsmæssige aktiviteter eller likviditetsfinansiering	Ikke relevant	Ikke relevant
1	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	UTI (unik handelsidentifikator)	Nej	Startdato for indberetningspligten
2	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	Indberetningens referencenummer	Nej	Startdato for indberetningspligten
3	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	Forudgående UTI (for forbindelserne én-til-én og én-til-mange mellem transaktioner)	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
4	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	UTI for efterfølgende position	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
5	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	ID for efterhandelstjenesteydelser til risikoreduktion (PTRR)	Ikke relevant	Ikke relevant
6	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	Identifikator for pakken	Ikke relevant	Ikke relevant
7	Afdeling 2b — Aftaledata	Internationale identifikationsnummer for værdipapirer (ISIN-nummer)	Nej	Startdato for indberetningspligten
8	Afdeling 2b — Aftaledata	Entydig produktidentifikator (UPI)	Nej	Startdato for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
9	Afdeling 2b — Aftaledata	Produktklassifikation	Nej	Startdato for indberetningspligten
10	Afdeling 2b — Aftaledata	Aftaletype	Nej	Startdato for indberetningspligten
11	Afdeling 2b — Aftaledata	Aktivklasse	Nej	Startdato for indberetningspligten
12	Afdeling 2b — Aftaledata	Derivat baseret på kryptoaktiver	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
13	Afdeling 2b — Aftaledata	Type identifikation af det underliggende aktiv	Nej	Startdato for indberetningspligten
14	Afdeling 2b — Aftaledata	Identifikation af det underliggende aktiv	Nej	Startdato for indberetningspligten
15	Afdeling 2b — Aftaledata	Indikator for det underliggende indeks	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
16	Afdeling 2b — Aftaledata	Navnet på det underliggende indeks	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
17	Afdeling 2b — Aftaledata	Kode for kundespecifik kurv	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
18	Afdeling 2b — Aftaledata	Identifikator for kurvens bestanddele	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
19	Afdeling 2b — Aftaledata	Afviklingsvaluta 1	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
20	Afdeling 2b — Aftaledata	Afviklingsvaluta 2	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
21	Afdeling 2c — Vurdering	Vurderingssum	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
22	Afdeling 2c — Vurdering	Vurderingsvaluta	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
23	Afdeling 2c — Vurdering	Tidsstempel for vurdering	Ikke relevant	Ikke relevant

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
24	Afdeling 2c — Vurdering	Vurderingsmetode	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
25	Afdeling 2c — Vurdering	Delta	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
26	Afdeling 2d — Sikkerhedsstillelse	Indikator for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Ikke relevant	Ikke relevant
27	Afdeling 2d — Sikkerhedsstillelse	Kode for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Ikke relevant	Ikke relevant
28	Afdeling 2e — Risikoreduktion/ indberetning	Tidsstempel for bekræftelse	Ja	Startdato for indberetningspligten
29	Afdeling 2e — Risikoreduktion/ indberetning	Bekræftet	Nej	Startdato for indberetningspligten
30	Afdeling 2f — Clearing	Clearingforpligtelse	Ja	Startdato for indberetningspligten
31	Afdeling 2f — Clearing	Clearet	Nej	Startdato for indberetningspligten
32	Afdeling 2f — Clearing	Tidsstempel for clearing	Ja	Startdato for indberetningspligten
33	Afdeling 2f — Clearing	Central modpart	Nej	Startdato for indberetningspligten
34	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Masteraftaletype	Ja	Startdato for indberetningspligten
35	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Andre typer masteraftaler	Ikke relevant	Ikke relevant
36	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Masteraftaleversion	Nej	Startdato for indberetningspligten
37	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Koncernintern	Nej	Startdato for indberetningspligten
38	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	PTRR	Nej	Startdato for indberetningspligten
39	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Type af PTRR-teknik	Nej	Startdato for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
40	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	PTRR-tjenesteudbyder	Nej	Startdato for indberetningspligten
41	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Handelssted	Nej	Startdato for indberetningspligten
42	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Tidsstempel for gennemførelse	Ja	Startdato for indberetningspligten
43	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato	Nej	Startdato for indberetningspligten
44	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Udløbsdato	Nej	Startdato for indberetningspligten
45	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Dato for førtidig afvikling	Nej	Startdato for indberetningspligten
46	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Endelig kontraktlig afviklingsdato	Nej	Startdato for indberetningspligten
47	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Leveringstype	Nej	Startdato for indberetningspligten
48	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Pris	Ja	Startdato for indberetningspligten
49	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Prisvaluta	Nej	Startdato for indberetningspligten
50	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikke-reguleret ikrafttrædelsesdato for prisen	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
51	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikke-reguleret slutdato for prisen	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
52	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Gældende pris mellem den ikke- regulerede ikrafttrædelsesdato og slutdatoen	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
53	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Pris for pakketransaktioner	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
54	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Valuta for prisen på pakketransaktioner	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
55	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel værdi af første ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
56	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel valuta 1	Nej	Startdato for indberetningspligten
57	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den notionelle værdi af første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
58	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den notionelle værdi af første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
59	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel værdi, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for første ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
60	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Samlet notionel mængde af første ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
61	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den notionelle mængde af første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
62	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den notionelle mængde af første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
63	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel mængde, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for første ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
64	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionelt beløb for andet ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
65	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel valuta 2	Nej	Startdato for indberetningspligten
66	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den notionelle værdi af andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
67	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den notionelle værdi af andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
68	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel værdi, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for andet ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
69	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Samlet notionel mængde af andet ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
70	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den notionelle mængde af andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
71	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den notionelle mængde af andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
72	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notional mængde, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for andet ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
73	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Anden betalingstype	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
74	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Andet betalingsbeløb	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
75	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Anden betalingsvaluta	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
76	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Anden betalingsdato	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
77	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Indbetaler af andre betalingsbeløb	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
78	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Modtager af andre betalingsbeløb	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
79	Afdeling 2h — Rentesatser	Fast rente for første ben eller kuponbetaling	Ja	Startdato for indberetningspligten
80	Afdeling 2h — Rentesatser	Konvention for renteberegningsdage for den faste rente for første ben eller for kuponbetaling	Nej	Startdato for indberetningspligten
81	Afdeling 2h — Rentesatser	Hypigheden for betaling af den faste rente for første ben eller for kuponbetaling	Nej	Startdato for indberetningspligten
82	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for hypigheden for betaling af den faste rente for første ben eller for kuponbetaling	Nej	Startdato for indberetningspligten
83	Afdeling 2h — Rentesatser	Identifikator for den variable rente for første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
84	Afdeling 2h — Rentesatser	Indikator for den variable rente for første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
85	Afdeling 2h — Rentesatser	Navnet på den variable rente for første ben	Ikke relevant	Ikke relevant
86	Afdeling 2h — Rentesatser	Konvention for renteberegningsdage for den variable rente for første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
87	Afdeling 2h — Rentesatser	Betalingshyppigheden for den variable rente for første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
88	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden for den variable rente for første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
89	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for første ben — tidsperiode	Nej	Startdato for indberetningspligten
90	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for første ben — multiplikator	Nej	Startdato for indberetningspligten
91	Afdeling 2h — Rentesatser	Tilpasning af hyppigheden for den variable rente for første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
92	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for tilpasning af hyppigheden for den variable rente for første ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
93	Afdeling 2h — Rentesatser	Spreadet for første ben	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
94	Afdeling 2h — Rentesatser	Valuta for spreadet for første ben	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
95	Afdeling 2h — Rentesatser	Fast rente for andet ben	Ja	Startdato for indberetningspligten
96	Afdeling 2h — Rentesatser	Konvention for renteberegningsdage for den faste rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
97	Afdeling 2h — Rentesatser	Betalingshyppigheden for den faste rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
98	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden for den faste rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
99	Afdeling 2h — Rentesatser	Identifikator for den variable rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
100	Afdeling 2h — Rentesatser	Indikator for den variable rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
101	Afdeling 2h — Rentesatser	Navnet på den variable rente for andet ben	Ikke relevant	Ikke relevant
102	Afdeling 2h — Rentesatser	Konvention for renteberegningsdage for den variable rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
103	Afdeling 2h — Rentesatser	Betalingshyppigheden for den variable rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
104	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden for den variable rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
105	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — tidsperiode	Nej	Startdato for indberetningspligten
106	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — multiplikator	Nej	Startdato for indberetningspligten
107	Afdeling 2h — Rentesatser	Tilpasning af hyppigheden for den variable rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
108	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for tilpasning af hyppigheden for den variable rente for andet ben	Nej	Startdato for indberetningspligten
109	Afdeling 2h — Rentesatser	Spreadet for andet ben	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
110	Afdeling 2h — Rentesatser	Valuta for spreadet for andet ben	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
111	Afdeling 2h — Rentesatser	Spread for pakke­transaktioner	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
112	Afdeling 2h — Rentesatser	Valuta for spreadet på pakke­transaktioner	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
113	Afdeling 2i — Udenlandsk valuta	Valutakurs 1	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
114	Afdeling 2i — Udenlandsk valuta	Valutaterminkurs	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
115	Afdeling 2i — Udenlandsk valuta	Valutakursgrundlag	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
116	Afdeling 2j — Råvarer og emissionskvoter (generelt)	Basisprodukt	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
117	Afdeling 2j — Råvarer og emissionskvoter (generelt)	Underprodukt	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
118	Afdeling 2j — Råvarer og emissionskvoter (generelt)	Yderligere underprodukt	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
119	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Leveringssted eller -område	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
120	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Forbindelsespunkt	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
121	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Belastningstype	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
122	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Begyndelsestidspunkt for leveringsinterval	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
123	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Sluttidspunkt for leveringsinterval	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
124	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Begyndelsestidspunkt for levering	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
125	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Slutdato for levering	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
126	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Varighed	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
127	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Ugedage	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
128	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Leveringskapacitet	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
129	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Antal enheder	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
130	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Prisen på og tidsintervallet for mængde	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
131	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Valuta for prisen på og tidsintervallet for mængden	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
132	Afdeling 2l — Optioner	Optionsform	Nej	Startdato for indberetningspligten
133	Afdeling 2l — Optioner	Optionstype	Nej	Startdato for indberetningspligten
134	Afdeling 2l — Optioner	Strikepris	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
135	Afdeling 2l — Optioner	Ikrafttrædelsesdato for strikeprisen	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
136	Afdeling 2l — Optioner	Slutdato for strikeprisen	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
137	Afdeling 2l — Optioner	Strikepris gældende på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
138	Afdeling 2l — Optioner	Strikeprisvaluta/valutapar	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
139	Afdeling 2l — Optioner	Optionspræmiebeløb	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
140	Afdeling 2l — Optioner	Optionspræmievaluta	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
141	Afdeling 2l — Optioner	Dato for betaling af optionspræmie	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten

	Afsnit	Felt	Afstemningstolerance	Startdato for afstemning
142	Afdeling 2i — Optioner	Udløbsdato for det underliggende aktiv	Nej	Startdato for indberetningspligten
143	Afdeling 2m — Kreditderivater	Rang	Nej	Startdato for indberetningspligten
144	Afdeling 2m — Kreditderivater	Referenceenhed	Nej	Startdato for indberetningspligten
145	Afdeling 2m — Kreditderivater	Serier	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
146	Afdeling 2m — Kreditderivater	Version	Nej	To år efter startdatoen for indberetningspligten
147	Afdeling 2m — Kreditderivater	Indeksfaktor	Ja	Startdato for indberetningspligten
148	Afdeling 2m — Kreditderivater	Tranche	Nej	Startdato for indberetningspligten
149	Afdeling 2m — Kreditderivater	Attachment point for Credit Default Swap (CDS) indeks	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
150	Afdeling 2m — Kreditderivater	Detachment point for CDS-indeks	Ja	To år efter startdatoen for indberetningspligten
151	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Type handling	Ikke relevant	Ikke relevant
152	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Hændelsestype	Ikke relevant	Ikke relevant
153	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Dato for begivenhed	Ikke relevant	Ikke relevant
154	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Niveau	Nej	Startdato for indberetningspligten

Tabel 3

Afstemningskategorier	Værdier, der kan tillades
Indberetningskrav for begge modparter	Ja/nej
Indberetningstype	Enkeltsidet/dobbeltsidet
Parring	Match/ikke-match
Afstemning	Afstemt/ikke-afstemt
Afstemning af værdiansættelse	Afstemt/ikke-afstemt
Genåbnet	Ja/nej
Yderligere ændringer	Ja/nej