

II

(Ikke-lovgivningsmæssige retsakter)

FORORDNINGER

KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) 2019/356

af 13. december 2018

om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2015/2365 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder, der præciserer de oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner, der skal indberettes til transaktionsregistre

(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 4, stk. 9, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) For at øge effektiviteten og øge lighederne mellem indberetningen af derivater og indberetningen af værdipapirfinansieringstransaktioner bør forpligtelsen til at indberette oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner til transaktionsregistre i henhold til artikel 4 i forordning (EU) 2015/2365 tilpasses forpligtelsen til at indberette derivattransaktioner til transaktionsregistre i henhold til artikel 9 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 ⁽²⁾. De indberetningskrav, der præciserer oplysningerne om værdipapirfinansieringstransaktioner, bør derfor svare til de indberetningskrav, der præciserer oplysningerne om derivataftaler.
- (2) For at sikre, at indberettede oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner er effektive og nyttige, bør de specifikke oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktionerne, der skal indberettes, tilpasses de forskellige typer værdipapirfinansieringstransaktioner, der er identificeret i forordning (EU) 2015/2365. Med hensyn til indberetning af margenudlånstransaktioner er formålet med forordning (EU) 2015/2365 at registrere transaktioner, der tjener samme formål som genkøbstransaktioner, buy/sell-back-transaktioner eller transaktioner med udlån af værdipapirer og derfor udgør lignende risici for den finansielle stabilitet ved at muliggøre opbygningen af gearing, procyklalitet og indbyrdes forbindelser på de finansielle markeder eller ved at bidrage til likviditets- og løbetidsændring. Margenudlån omfatter derfor transaktioner, der er omfattet af margenaftaler mellem finansielle institutioner og deres kunder, hvor finansielle institutioner yder mægler tjenester til deres kunder, men de omfatter ikke andre lån, som f.eks. lån til virksomhedsomstrukturingsformål, som på trods af muligheden for at inddrage værdipapirer ikke bidrager til de systemiske risici, der er omhandlet i forordning (EU) 2015/2365.
- (3) Det er vigtigt, at oplysningerne om enhver værdipapirfinansieringstransaktion, der cleares af en central modpart, indberettes korrekt og let kan identificeres, uanset om den pågældende værdipapirfinansieringstransaktion blev clearet samme dato eller på en senere dato end den dato, hvor den pågældende værdipapirfinansieringstransaktion blev indgået.
- (4) For at sikre fuldstændig indberetning, hvor specifikke oplysninger om sikkerhedsstillelsen ikke er kendt på handelsdagen, bør modparterne ajourføre oplysningerne om sikkerhedsstillelsen, så snart disse oplysninger foreligger for modparterne, og senest den første arbejdsdag efter værdipapirfinansieringstransaktionens valørdato.

⁽¹⁾ EUT L 337 af 23.12.2015, s. 1.

⁽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).

- (5) For at give yderligere nyttige oplysninger til de myndigheder, der har adgang til oplysningerne om værdipapirfinansieringstransaktioner i transaktionsregistre, bør modparter til transaktionsregistre indberette det internationale identifikationsnummer (»ISIN«) for enhver sikkerhedsstillelseskurv, som de anvender til at stille sikkerhed i forbindelse med en værdipapirfinansieringstransaktion, hvis denne kurv har en ISIN-kode.
- (6) Hvis modparterne stiller sikkerhed på et nettoeksponeringsgrundlag, der fremkommer ved modregning af et antal værdipapirfinansieringstransaktioner mellem to modparter, er en specifik allokering af sikkerhedsstillelsen for en enkelt værdipapirfinansieringstransaktion ofte ikke mulig, og tildelingen af sikkerhedsstillelsen kendes muligvis derfor ikke. I disse tilfælde bør modparterne kunne indberette sikkerhedsstillelsen uafhængigt af det underliggende lån.
- (7) 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⁾.
- (8) 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

Oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner, der skal indberettes

1. Indberetninger, der udarbejdes i henhold til artikel 4, stk. 1, i forordning (EU) 2015/2365, indeholder de fuldstændige og nøjagtige oplysninger, der er fastsat i tabel 1, 2, 3 og 4 i det bilag, som vedrører den pågældende værdipapirfinansieringstransaktion.
2. Ved indberetning af indgåelsen af en værdipapirfinansieringstransaktion angiver en modpart i sin indberetning handlingstypen »Ny« i felt 98 i tabel 2 i bilaget til denne forordning. I eventuelle efterfølgende indberetninger af oplysninger om denne værdipapirfinansieringstransaktion angives i felt 98 i tabel 2 i bilaget til denne forordning den relevante handlingstype, der vedrører denne værdipapirfinansieringstransaktion.

Artikel 2

Værdipapirfinansieringstransaktioner, der cleares af centrale modparter

1. En værdipapirfinansieringstransaktion, som allerede er indberettet i henhold til artikel 4, stk. 1, i forordning (EU) 2015/2365, og som efterfølgende cleares af en central modpart, indberettes efter clearing som afviklet ved i felt 98 i tabel 2 i bilaget at angive handlingstypen »Ophævelse/Førtidig ophævelse«, og nye værdipapirfinansieringstransaktioner, som følger af clearing, indberettes.
2. En værdipapirfinansieringstransaktion, der indgås på en handelsplads, og som cleares af en central modpart samme dag, indberettes først, efter at den pågældende værdipapirfinansieringstransaktion er clearet.
3. En modpart skal for den margen, der stilles eller modtages for en clearet værdipapirfinansieringstransaktion, indberette oplysningerne i tabel 3 i bilaget til denne forordning og præcisere den relevante handlingstype, der er fastlagt i felt 20 i nævnte tabel i bilaget.

Artikel 3

Indberetning af sikkerhedsstillelse

1. Modparter i en transaktion vedrørende udlån i værdipapirer eller råvarer eller en transaktion vedrørende indlån af værdipapirer eller råvarer, som accepterer, at der ikke stilles sikkerhed, angiver dette i felt 72 i tabel 2 i bilaget.
2. Hvis sikkerhedsstillelsen for en værdipapirfinansieringstransaktion er knyttet til et individuelt lån, og modparten kender oplysningerne om sikkerhedsstillelsen inden indberetningsfristen, angiver modparten de fuldstændige og nøjagtige oplysninger om alle de enkelte komponenter af sikkerhedsstillelsen for den pågældende værdipapirfinansieringstransaktion i felt 75-94 i tabel 2 i bilaget, når denne værdipapirfinansieringstransaktion indberettes for første gang med handlingstypen »Ny« i felt 98 i tabel 2 i bilaget.

⁽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).

3. Hvis sikkerhedsstillelsen for en værdipapirfinansieringstransaktion er knyttet til et individuelt lån, men modparten kender ikke oplysningerne om sikkerhedsstillelsen inden indberetningsfristen, angiver modparten, med handlingstypen »ajourføring af sikkerhedsstillelse« i felt 98 i tabel 2 i bilaget, de fuldstændige og nøjagtige oplysninger om alle de enkelte komponenter af sikkerhedsstillelsen for den pågældende værdipapirfinansieringstransaktion i felt 75-94 i tabel 2 i bilaget, så snart disse er kendt og senest på arbejdsdagen efter den valørdato, der er fastsat i felt 13 i tabel 2 i bilaget.
4. En modpart, der stiller sikkerhed for en eller flere værdipapirfinansieringstransaktioner med en sikkerhedsstillelseskurv, der er identificeret ved et internationalt identifikationsnummer for værdipapirer (»ISIN«), angiver ISIN-koden i felt 96 i tabel 2 i bilaget, når denne indberettes med handlingstypen »Ny« i felt 98 i tabel 2 i bilaget.
5. En modpart, der stiller sikkerhed for en eller flere værdipapirfinansieringstransaktioner med en sikkerhedsstillelseskurv, der ikke er identificeret ved en ISIN-kode, angiver NTAV-koden i felt 96 i tabel 2 i bilaget, når værdipapirfinansieringstransaktionen indberettes med handlingstypen »Ny« i felt 98 i tabel 2 i bilaget.
6. Med henblik på stk. 4 og 5 angiver modparten, med handlingstypen »ajourføring af sikkerhedsstillelse« i felt 98 i tabel 2 i bilaget, de fuldstændige og nøjagtige oplysninger om alle de enkelte komponenter af sikkerhedsstillelsen for den pågældende værdipapirfinansieringstransaktion i felt 75-94 i tabel 2 i bilaget, så snart disse oplysninger er kendt og senest på arbejdsdagen efter den valørdato, der er fastsat i felt 13 i tabel 2 i bilaget.
7. En modpart, der stiller sikkerhed for flere værdipapirfinansieringstransaktioner på et nettoeksponeringsgrundlag, angiver værdien »rigtigt« (true) i felt 73 i tabel 2 i bilaget. Denne modpart angiver, med handlingstypen »ajourføring af sikkerhedsstillelse« i felt 98 i tabel 2 i bilaget, de fuldstændige og nøjagtige oplysninger om alle de enkelte komponenter af sikkerhedsstillelsen for de pågældende værdipapirfinansieringstransaktioner i felt 75-94 i tabel 2 i bilaget, så snart disse oplysninger er kendt og senest på arbejdsdagen efter den valørdato, der er fastsat i felt 13 i tabel 2 i bilaget.

Artikel 4

Indberetning om genanvendelse af sikkerhedsstillelse

1. En modpart, der modtager et eller flere finansielle instrumenter som sikkerhedsstillelse i en værdipapirfinansieringstransaktion, angiver de fuldstændige og nøjagtige oplysninger om enhver genanvendelse af hvert enkelt af disse finansielle instrumenter i felt 7, 8 og 9 i tabel 4 i bilaget.
2. En modpart, der modtager kontanter som sikkerhedsstillelse i en værdipapirfinansieringstransaktion, angiver de fuldstændige og nøjagtige oplysninger om enhver geninvestering af alle kontanter i forbindelse med sikkerhedsstillelsen for hver enkelt valuta i felt 11, 12 og 13 i tabel 4 i bilaget.

Artikel 5

Ikrafttræden

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

Denne forordning 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

Tabel 1

Modpartsdata

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
1	Tidsstempel for indberetningen	Dato og klokkeslæt for indberetning til transaktionsregistret.	Y	Y	Y	Y
2	Indberettende enhed	Entydig identifikationskode for den indberettende enhed. Hvis indgivelsen af indberetningen er delegeret til en tredjepart eller til den anden modpart, en entydig identifikationskode for denne enhed.	Y	Y	Y	Y
3	Indberettende modpart	Entydig identifikationskode for den indberettende modpart.	Y	Y	Y	Y
4	Type indberettende modpart	Angivelse af, om den indberettende modpart er en finansiel eller ikke-finansiel modpart.	Y	Y	Y	Y
5	Den indberettende modparts sektor	En eller flere koder til klassificering af arten af den indberettende modparts forretningsaktiviteter. Hvis den indberettende modpart er en finansiel modpart, alle de relevante koder, som indgår i taksonomien for finansielle modparter, og som finder anvendelse på den pågældende modpart. Hvis den indberettende modpart er en ikke-finansiel modpart, alle de relevante koder, som indgår i taksonomien for ikke-finansielle modparter, og som finder anvendelse på den pågældende modpart. Hvis der indberettes mere end en enkelt aktivitet, angives koderne efter de tilsvarende aktiviteter relative betydning.	Y	Y	Y	Y
6	Supplerende klassificering af sektor	Hvis den indberettende modpart er et institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) eller en alternativ investeringsfond (AIF) en kode, der fastlægger, om det er en ETF (exchange-traded fund) eller en pengemarkedsforening. Hvis den indberettende modpart er en alternativ investeringsfond (AIF) eller en ikke-finansiel modpart, der foretager finansielle og forsikringsmæssige aktiviteter eller aktiviteter i forbindelse med fast ejendom, en kode, der fastlægger, om det er en trust til ejendomsinvesteringer (REIT).	Y	Y	Y	Y
7	Filial af den indberettende modpart	Hvis den indberettende modpart indgår en værdipapirfinansieringstransaktion gennem en filial, den kode, der identificerer filialen.	Y	Y	Y	Y
8	Filial af den anden modpart	Hvis den anden modpart indgår en værdipapirfinansieringstransaktion gennem en filial, den kode, der identificerer filialen.	Y	Y	Y	Y

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
9	Modpartsside	Angivelse af, om den indberettende modpart er en sikkerhedsstiller eller en sikkerhedshaver i overensstemmelse med artikel 4 i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2019/363 ⁽¹⁾	Y	Y	Y	Y
10	Enhed, der er ansvarlig for indberetningen	Hvis en finansiel modpart er ansvarlig for indberetningen på den anden modparts vegne i henhold til artikel 4, stk. 3, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2015/2365 ⁽²⁾ , den entydige identifikationskode for den finansielle modpart. Hvis et administrationsselskab er ansvarligt for indberetningen på vegne af et institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) i henhold til artikel 4, stk. 3, i samme forordning, angives den entydige identifikationskode for administrationsselskabet. Hvis en forvalter af alternative investeringsfonde (FAIF'er) er ansvarlig for indberetningen på vegne af en alternativ investeringsfond (AIF) i henhold til artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365, angives den entydige identifikationskode for denne FAIF.	Y	Y	Y	Y
11	Anden modpart	Den entydige identifikationskode for den enhed, med hvilken den indberettende modpart har indgået en værdipapirfinansieringstransaktion. Hvis der er tale om en privatperson, anvendes der konsekvent en kundekode.	Y	Y	Y	Y
12	Den anden modparts land	Koden for det land, hvor den anden modparts vedtægtsmæssige hjemsted er beliggende, eller koden for hjemlandet, hvis den anden modpart er en fysisk person.	Y	Y	Y	Y
13	Modtager	Hvis den berettigede modtager for aftalen ikke er en modpart i denne aftale, skal den indberettende modpart anføre en entydig identifikationskode for denne modtager eller, hvis der er tale om en privatperson, den kundekode, der konsekvent anvendes og er tildelt af den juridiske person, som denne privatperson anvender.	Y	Y	Y	N
14	Trepartsagent	Den entydige identifikationskode for den tredje part, til hvilken den indberettende modpart eventuelt har uddelegeret behandlingen efter handelen af en værdipapirfinansieringstransaktion.	Y	Y	Y	N
15	Mægler	Den entydige identifikationskode for den enhed, der optræder som mellemed for den indberettende modpart uden selv at blive modpart til værdipapirfinansieringstransaktionen. Med hensyn til transaktioner med udlån af værdipapirer omfatter en mægler ikke låneagenten.	Y	Y	Y	N

⁽¹⁾ 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 gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 for så vidt angår anvendelsen af indberetningskoder i forbindelse med indberetning af derivataftaler (se side 85 i denne EUT).

⁽²⁾ 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 (EUT L 337 af 23.12.2015, s. 1).

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
16	Clearingmedlem	Hvis handelen cleares, den entydige identifikationskode for den indberettende modparts ansvarlige clearingmedlem	Y	Y	Y	N
17	Deltager eller indirekte deltager i værdipapircentraler	Den entydige identifikationskode for den indberettende modparts deltager eller indirekte deltager i en værdipapircentral. Hvis både deltageren eller den indirekte deltager i en værdipapircentral er involveret i transaktionen, koden for den indirekte deltager. Dette felt gælder ikke for råvarer.	Y	Y	Y	N
18	Låneagent	Den entydige identifikationskode for låneagenten i en transaktion med udlån af værdipapirer.	Y	N	Y	N

Tabel 2

Data om lån og sikkerhedsstillelse

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
1	Entydig transaktionsidentifikator (UTI)	Entydig reference tildelt værdipapirfinansieringstransaktionen med henblik på at identificere handelen.	Y	Y	Y	Y
2	Indberetningens referencenummer	For transaktioner, der er en følge af clearing, indberettes den første UTI, dvs. UTI'en for den oprindelige bilaterale transaktion. Den første UTI er dog ikke nødvendig ved indberetning foretaget af modparter, der er centrale modparter, som har clearet værdipapirfinansieringstransaktionen. Når der udføres en værdipapirfinansieringstransaktion på en handelsplads, og den cleares samme dag, genereres der et nummer af handelspladsen, som er entydigt for denne udførte transaktion.	Y	Y	Y	N
3	Dato for hændelsen	Dato, på hvilken den indberetningspligtige hændelse, der vedrører værdipapirfinansieringstransaktionen, og som fremgår af indberetningen, fandt sted. For handlingstyperne »Valuation update« (værdiajourføring), »Collateral update« (ajourføring af sikkerhedsstillelse), »Reuse update« (ajourføring af genanvendelse), »Margin update« (ajourføring af margen) den dato, for hvilken de indberettede oplysninger anføres.	Y	Y	Y	Y
4	Type værdipapirfinansieringstransaktion	Typen af værdipapirfinansieringstransaktion som defineret i artikel 3, stk. 7-10, i forordning (EU) 2015/2365.	Y	Y	Y	Y
5	Clearet	Angivelse af, om der har fundet en central clearing sted.	Y	Y	Y	N
6	Tidsstempel for clearing	Klokkeslæt og dato for clearing.	Y	Y	Y	N
7	Central modpart	Hvis en aftale er blevet clearet, den entydige kode for den centrale modpart, der har clearet aftalen.	Y	Y	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
8	Handelsplads	Entydig identifikationskode for værdipapirfinansieringstransaktionens handelssted. Hvis værdipapirfinansieringstransaktionen blev indgået OTC og optaget til handel, MIC-koden »XOFF«. Hvis værdipapirfinansieringstransaktionen blev indgået OTC og ikke optaget til handel, MIC-koden »XXXX«.	Y	Y	Y	N
9	Type masteraftale	Henvisning til type masteraftale, i henhold til hvilken modparterne indgik en værdipapirfinansieringstransaktion.	Y	Y	Y	N
10	Anden type masteraftale	Navnet på masteraftalen Dette felt udfyldes kun, hvis der i felt 9 står »OTHR«.	Y	Y	Y	N
11	Masteraftaleversion	Angivelse af året for den masteraftale, der i givet fald er anvendt ved den indberettede transaktion.	Y	Y	Y	N
12	Tidsstempel for gennemførelse	Dato og klokkeslæt for værdipapirfinansieringstransaktionens gennemførelse.	Y	Y	Y	Y
13	Valørdato (Startdato)	Den af modparterne kontraktligt fastsatte dato for udvekslingen af kontanter, værdipapirer eller råvarer mod sikkerhedsstillelse for den første del (spotbenet) af værdipapirfinansieringstransaktionen.	Y	Y	Y	N
14	Udløbsdato (Slutdato)	Den af modparterne kontraktligt fastsatte dato for udvekslingen af kontanter, værdipapirer eller råvarer mod sikkerhedsstillelse for den sidste del (forwardbenet) af værdipapirfinansieringstransaktionen. Denne oplysning indberettes ikke for repoer uden fastsat løbetid.	Y	Y	Y	N
15	Ophævelsesdato	Ophævelsesdatoen i tilfælde af tidlig fuldstændig ophævelse af værdipapirfinansieringstransaktionen.	Y	Y	Y	Y
16	Minimumsfrist for opsigelse	Mindsteantal forretningsdage, som en modpart har til at underrette den anden modpart om transaktionens ophævelse.	Y	N	N	N
17	Første mulige dato for call-back	Første mulige dato, på hvilken långiveren af kontanter har ret til at tilbagekalde en del af midlerne eller ophæve transaktionen.	Y	N	N	N
18	Indikator for generel sikkerhedsstillelse	Angivelse af, om værdipapirfinansieringstransaktionen er omfattet af en generel ordning om sikkerhedsstillelse. For en transaktion med udlån af værdipapirer henviser feltet til værdipapirer, der stilles som sikkerhed, og ikke til det værdipapir, der anvendes i forbindelse med lån.	Y	Y	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
		<p>Koden »GENE« skal angives for en værdipapirfinansieringstransaktion, der er omfattet af en generel ordning om sikkerhedsstillelse. En generel ordning om sikkerhedsstillelse er en ordning om sikkerhedsstillelse for en transaktion, i hvilken sikkerhedsstilleren kan vælge det værdipapir, der stilles som sikkerhed, blandt et relativt bredt udvalg af værdipapirer, der opfylder forudbestemte kriterier.</p> <p>Koden »SPEC« skal angives for en værdipapirfinansieringstransaktion, der er omfattet af en specifik ordning om sikkerhedsstillelse. En specifik ordning om sikkerhedsstillelse er en ordning om sikkerhedsstillelse for en transaktion, hvor sikkerhedshaver anmoder om et specifikt internationalt identifikationsnummer for værdipapirer (»ISIN«), der skal forelægges af sikkerhedsstilleren.</p>				
19	DBV-indikator (DBV = Delivery By Value)	Angivelse af, om transaktionen blev gennemført ved at anvende DBV-mekanismen.	Y	N	Y	N
20	Metode anvendt til sikkerhedsstillelse	<p>Angivelse af, om sikkerhedsstillelsen for en værdipapirfinansieringstransaktion er underlagt en aftale om sikkerhedsstillelse i form af overdragelse af ejendomsret, en aftale om finansiell sikkerhedsstillelse i form af pantsætning eller en aftale om finansiell sikkerhedsstillelse med brugsret.</p> <p>Hvis der blev anvendt mere end én metode til at stille sikkerhed, angives den første ordning vedrørende sikkerhedsstillelse i dette felt.</p>	Y	N	Y	Y
21	Uden fastsat løbetid	<p>Angivelse af, om værdipapirfinansieringstransaktionen er uden fastsat løbetid (dvs. uden fastsat udløbsdato) eller har en fastsat løbetid med en kontraktbestemt udløbsdato.</p> <p>Koden »True« (rigtigt) anvendes for værdipapirfinansieringstransaktioner uden fastsat løbetid, og koden »False« (forkert) anvendes for værdipapirfinansieringstransaktioner med fastsat løbetid.</p>	Y	N	Y	N
22	Ophævelsesmulighed	Angivelse af, om værdipapirfinansieringstransaktionen er ubegrænset eller kan forlænges.	Y	N	Y	N

For margenudlån gentages felt 23-34 og udfyldes for hver enkelt valuta, der er anvendt i margenlånet.

23	Fast rente	<p>For repoer den årlige rentesats for genkøbstransaktionens nominelle beløb i overensstemmelse med konventionen for beregning af dage.</p> <p>For margenudlån den årlige rentesats for det lånebeløb, som låntager betaler långiver.</p>	Y	N	N	Y
----	------------	---	---	---	---	---

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
24	Konvention for beregning af dage	Metode til beregning af den påløbne rente på det nominelle beløb til en given sats.	Y	N	N	Y
25	Variabel rente	Angivelse af den referencerentesats, der anvendes, og som genfastsættes med faste mellemrum, under henvisning, i givet fald, til en markedsreferencerente.	Y	N	N	Y
26	Referenceperiode for variabel rente — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rente.	Y	N	N	Y
27	Referenceperiode for variabel rente — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rente angivet i felt 26.	Y	N	N	Y
28	Betalingshyppighed for variabel rente — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver betalingshyppigheden for den variable rente.	Y	N	N	Y
29	Betalingshyppighed for variabel rente — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver betalingshyppigheden for den variable rente angivet i felt 28.	Y	N	N	Y
30	Hyppighed for genfastsættelse af den variabel rente — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver hyppigheden for genfastsættelsen af den variable rente.	Y	N	N	Y
31	Hyppighed for genfastsættelse af den variabel rente — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver hyppigheden for genfastsættelsen af den variable rente angivet i felt 30.	Y	N	N	Y
32	Spænd	Antal basispoint, der skal lægges til eller trækkes fra den variable rente for at kunne fastsætte renten på lånet.	Y	N	N	Y
33	Margenudlåns valutabeløb	Margenudlånets beløb i en given valuta.	N	N	N	Y
34	Margenudlåns valuta	Margenudlånets valuta.	N	N	N	Y

Felt 35 og 36 gentages og udfyldes for hver enkelt justering af den variable rente.

35	Justeret rente	Rente som fastsat i rentesatstabellen	Y	N	N	N
----	----------------	---------------------------------------	---	---	---	---

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
36	Rentedato	Dato, fra hvilken renten er effektiv	Y	N	N	N
37	Nominelt beløb på valørdato	Kontantværdi, der skal betales på transaktionens valørdato.	Y	Y	N	N
38	Nominelt beløb på udløbsdato	Kontantværdi, der skal betales på transaktionens udløbsdato.	Y	Y	N	N
39	Nominelt beløbs valuta	Valutaen for det nominelle beløb.	Y	Y	N	N
40	Aktivtype	Angivelse af, hvilken aktivtype der er omfattet af værdipapirfinansieringstransaktionen.	N	N	Y	N
41	Identifikator for værdipapir	Identifikation af, hvilket værdipapir der er omfattet af værdipapirfinansieringstransaktionen. Dette felt gælder ikke for råvarer.	N	N	Y	N
42	Værdipapirsklassifikation	CFI-kode (Classification of Financial Instruments) for det værdipapir, der er omfattet af værdipapirfinansieringstransaktionen. Dette felt gælder ikke for råvarer.	N	N	Y	N

Hvis en råvare blev lånt (ud- eller indlån), angives klassifikationen af denne råvare i felt 43, 44 og 45.

43	Basisprodukt	Basisprodukt som anført i råvareklassifikationen i tabel 5 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363.	N	N	Y	N
44	Underprodukt	Underprodukt som anført i råvareklassifikationen i tabel 5 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363. Dette felt kræver et specifikt basisprodukt i felt 43.	N	N	Y	N
45	Yderligere underprodukt	Yderligere underprodukt som anført i råvareklassifikationstabellen. Dette felt kræver et specifikt underprodukt i felt 44.	N	N	Y	N
46	Kvantitet eller nominelt beløb	Kvantitet eller nominelt beløb for det værdipapir eller den råvare, der er omfattet af værdipapirfinansieringstransaktionen. For obligationer det samlede nominelle beløb, hvilket betyder antallet af obligationer ganget med deres pålydende værdi. For andre værdipapirer eller råvarer deres mængde.	N	N	Y	N
47	Måleenhed	Måleenhed anvendt til at udtrykke mængden. Dette felt gælder for råvarer.	N	N	Y	N
48	Nominelt beløbs valuta	Hvis det nominelle beløb indberettes det nominelle beløbs valuta	N	N	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
49	Værdipapirkurs eller råvarepris	For ud- og indlån i værdipapirer eller råvarer kursen på værdipapiret eller prisen på råvaren, der er anvendt til beregning af lånebeløbet. For en buy-sell back-transaktion kursen på værdipapiret eller prisen på råvaren, der er anvendt til beregning af transaktionsbeløbet for spotbetnet af buy-sell back-transaktionen.	N	Y	Y	N
50	Prisvaluta	Den valuta, i hvilken kursen på værdipapiret eller prisen på råvaren er angivet.	N	N	Y	N
51	Værdipapirets kvalitet	Kode, som klassificerer værdipapirets kreditrisiko.	N	N	Y	N
52	Værdipapirets løbetid	Værdipapirets løbetid. Dette felt gælder ikke for råvarer.	N	N	Y	N
53	Udstederens jurisdiktion	Jurisdiktionen for udstederen af værdipapiret. For værdipapirer udstedt af en udenlandsk dattervirksomhed den øverste modervirksomheds jurisdiktion eller, hvis den er ukendt, dattervirksomhedens jurisdiktion. Dette felt gælder ikke for råvarer.	N	N	Y	N
54	Udstederens LEI-kode	LEI-koden for udstederen af værdipapiret. Dette felt gælder ikke for råvarer.	N	N	Y	N
55	Værdipapirtype	Kode, som klassificerer værdipapirtypen.	N	N	Y	N
56	Lånebeløb	Lånebeløb, dvs. mængden eller lånets nominelle beløb ganget med prisen i felt 49.	N	N	Y	N
57	Markedsværdi	Markedsværdi for ud- og indlån i værdipapirer eller råvarer.	N	N	Y	N
58	Fast rabat	Fast rentesats (aftalt sats, som långiver betaler for geninvestering af den kontante sikkerhedsstillelse minus eventuelt vederlag), der betales af långiveren af værdipapiret eller råvaren til låntager (positiv rabat), eller betales af låntageren til långiver (negativ rabat) på saldoen af den kontante sikkerhedsstillelse.	N	N	Y	N
59	Variabel rabat	Angivelse af den referencerentesats, der er anvendt til beregningen af rabatten (aftalt sats, som långiver betaler for geninvestering af den kontante sikkerhedsstillelse minus eventuelt vederlag), der betales af långiveren af værdipapiret eller råvaren til låntager (positiv rabat), eller betales af låntageren til långiver (negativ rabat) på saldoen af den kontante sikkerhedsstillelse.	N	N	Y	N
60	Referenceperiode for variabel rabat — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rabat.	N	N	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
61	Referenceperiode for variabel rabat — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rabat angivet i felt 60.	N	N	Y	N
62	Betalingshyppighed for variabelt rabatbeløb — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver betalingshyppigheden for det variable rabatbeløb.	N	N	Y	N
63	Betalingshyppighed for variabelt rabatbeløb — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver betalingshyppigheden for det variable rabatbeløb angivet i felt 62.	N	N	Y	N
64	Hyppighed for genfastsættelse af det variable rabatbeløb — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver hyppigheden for genfastsættelse af det variable rabatbeløb.	N	N	Y	N
65	Hyppighed for genfastsættelse af det variable rabatbeløb — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver hyppigheden for genfastsættelse af det variable rabatbeløb angivet i felt 64.	N	N	Y	N
66	Rabatspænd	Spænd for det variable rabatbeløb udtrykt i basispoint.	N	N	Y	N
67	Vederlag	Gebyr, som låntager af værdipapiret eller råvaren betaler til långiver.	N	N	Y	N
68	Eksklusivaftaler	For ud- og indlån i værdipapirer en angivelse af, om låntager har eksklusiv adgang til at låne fra långivers værdipapirportefølje. Dette felt gælder ikke for råvarer.	N	N	Y	N
69	Udestående margenlån	Det samlede beløb for margenlån i basisvalutaen	N	N	N	Y
70	Udestående margenlåns basisvaluta	Udestående margenlåns basisvaluta	N	N	N	Y
71	Markedsværdi på kort sigt	Markedsværdi på kort sigt i basisvalutaen.	N	N	N	Y

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
-----	------	-----------------------------------	------	-----	----	----

Oplysninger om sikkerhedsstillelse

72	SL-signalisering af udlån i værdipapirer uden sikkerhedsstillelse	Angivelse af, om transaktionen med udlån i værdipapirer er uden sikkerhedsstillelse. Dette felt anvendes ikke, når modparterne er enige om at anvende sikkerhedsstillelse for handelen, og den specifikke allokering af sikkerhedsstillelsen endnu ikke kendes.	N	N	Y	N
73	Sikkerhedsstillelse for nettoeksponering	Angivelse af, om sikkerheden er stillet for en nettoeksponering snarere end for en enkelt transaktion.	Y	Y	Y	N
74	Sikkerhedsstillelsens valørdato	Hvis der er stillet sikkerhed for transaktionerne på nettoeksponeringsgrundlag den seneste valørdato for modregningen af værdipapirfinansieringstransaktionerne under hensyn til alle transaktioner, for hvilke der blev stillet sikkerhed.	Y	Y	Y	N

Hvis der blev anvendt specifik sikkerhedsstillelse, gentages og udfyldes felterne 75-94 i givet fald for hver enkelt komponent af sikkerhedsstillelsen.

75	Type sikkerhedsstillelseskomponent	Angivelse af typen af sikkerhedsstillelseskomponenter	Y	Y	Y	Y
----	------------------------------------	---	---	---	---	---

Hvis der blev anvendt kontanter til sikkerhedsstillelse, angives dette i felt 76 og 77.

76	Kontant sikkerhedsstillelsesbeløb	Pengebeløb stillet som sikkerhed for indlån af værdipapirer eller råvarer.	Y	Y	Y	N
77	Kontant sikkerhedsstillelses valuta	Den kontante sikkerhedsstillelses valuta.	Y	Y	Y	N
78	Identifikation af et værdipapir stillet som sikkerhed	Identifikation af det værdipapir, der er stillet som sikkerhed. Dette felt gælder ikke for råvarer.	Y	Y	Y	Y
79	Klassifikation af et værdipapir stillet som sikkerhed	CFI-kode for det værdipapir, der er stillet som sikkerhed. Dette felt gælder ikke for råvarer.	Y	Y	Y	Y

Hvis en råvare blev anvendt som sikkerhedsstillelse, angives klassifikationen af denne råvare i felt 80, 81 og 82.

80	Basisprodukt	Basisprodukt som anført i råvareklassifikationen i tabel 5 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363.	Y	Y	Y	N
81	Underprodukt	Underprodukt som anført i råvareklassifikationen i tabel 5 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363. Dette felt kræver et specifikt basisprodukt i felt 80.	Y	Y	Y	N
82	Yderligere underprodukt	Yderligere underprodukt som anført i råvareklassifikationen i tabel 5 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2019/363. Dette felt kræver et specifikt underprodukt i felt 81.	Y	Y	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
83	Sikkerhedsstillelsens kvantitet eller nominelle beløb	Kvantitet eller nominelt beløb for det værdipapir eller den råvare, der er stillet som sikkerhed. For obligationer det samlede nominelle beløb, hvilket betyder antallet af obligationer ganget med den pålydende værdi. For andre værdipapirer eller råvarer deres mængde.	Y	Y	Y	Y
84	Måleenhed for sikkerhedsstillelse	Måleenhed anvendt til at udtrykke den samlede sikkerhedsstillelse. Dette felt gælder for råvarer.	Y	Y	Y	N
85	Sikkerhedsstillelsens nominelle beløbs valuta	Hvis det nominelle beløb for sikkerhedsstillelsen indberettes det nominelle beløbs valuta.	Y	Y	Y	Y
86	Prisvaluta	Valuta for prisen på sikkerhedsstillelseskomponenten.	Y	Y	Y	Y
87	Pris pr. enhed	Pris pr. enhed af sikkerhedsstillelseskomponenten, herunder den påløbne rente for forrentede værdipapirer, som anvendes til vurdering af sikkerheden eller råvaren.	Y	Y	Y	Y
88	Sikkerhedsstillelsens markedsværdi	Markedsværdien for den enkelte sikkerhedsstillelseskomponent udtrykt i prisvaluta.	Y	Y	Y	Y
89	Haircut eller margen	For transaktioner af typen repoer og buy-sell backs angives enhver »haircut« af sikkerhedsstillelsen ved henvisning til enhver risikokontrolforanstaltning, der anvendes på den underliggende sikkerhedsstillelse, på ISIN-niveau, hvorved værdien af denne underliggende sikkerhedsstillelse beregnes som markedsværdien af aktiverne reduceret med en vis procentsats. For transaktioner med udlån af værdipapirer angives procentdelen af enhver »haircut« af sikkerhedsstillelsen ved henvisning til enhver risikokontrolforanstaltning, der anvendes på den underliggende sikkerhedsstillelse, enten på ISIN-niveau eller på porteføljeniveau, hvorved værdien af denne underliggende sikkerhedsstillelse beregnes som markedsværdien af aktiverne reduceret med en vis procentsats. For margenudlån procentsatsen af det margenkrav, der anvendes på den samlede sikkerhedsstillellesportefølje, som en kunde har på sin prime broker-konto. Faktiske værdier i modsætning til anslåede værdier eller standardværdier angives i dette felt.	Y	Y	Y	Y
90	Sikkerhedsstillelsens kvalitet	Kode, som klassificerer risikoen ved det værdipapir, der stilles som sikkerhed.	Y	Y	Y	Y
91	Værdipapirets udløbsdato	Udløbsdato for det værdipapir, der er stillet som sikkerhed. Dette felt gælder ikke for råvarer.	Y	Y	Y	Y

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
92	Udstederens jurisdiktion	Jurisdiktionen for den udsteder af det værdipapir, der stilles som sikkerhed. For værdipapirer udstedt af en udenlandsk dattervirksomhed indberettes den øverste modervirksomheds jurisdiktion eller, hvis den er ukendt, dattervirksomhedens jurisdiktion. Dette felt gælder ikke for råvarer.	Y	Y	Y	Y
93	Udstederens LEI-kode	LEI-koden for den udsteder af det værdipapir, der stilles som sikkerhed. Dette felt gælder ikke for råvarer.	Y	Y	Y	Y
94	Type sikkerhedsstillelse	Kode, som klassificerer den type værdipapir, der stilles som sikkerhed.				
95	Mulighed for genanvendelse af sikkerhedsstillelse	Angivelse af, om sikkerhedshaveren kan genanvende de værdipapirer, der stilles som sikkerhed.	Y	Y	Y	Y

Felt 96 angives, hvis der blev anvendt en sikkerhedsstillelseskurv. Den detaljerede allokering af sikkerhedsstillelse for værdipapirfinansieringstransaktioner, der gennemføres mod en sikkerhedspulje, angives i givet fald i felt 75-94.

96	Identifikator for sikkerhedsstillelseskurv	Hvis sikkerhedsstillelseskurven kan identificeres via en ISIN-kode, angives ISIN-koden for kurven. Hvis sikkerhedsstillelseskurven ikke kan identificeres via en ISIN-kode, udfyldes dette felt med »NTAV«-koden.	Y	Y	Y	N
97	Porteføljekode	Hvis transaktionen cleares og medtages i en portefølje af transaktioner, for hvilke der udveksles margenbetalinger, identificeres porteføljen ved en entydig kode, som fastsættes af den indberettende modpart. Hvis porteføljen af transaktioner også indeholder derivatavtaler, der er indberettelsespligtige i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012, skal porteføljekoden være den samme som den, der blev indberettet i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012.	Y	Y	Y	N
98	Handlingstype	Indberetningen skal indeholde én af de følgende handlingstyper: a) en værdipapirfinansieringstransaktion, der indberettes for første gang, betegnes som »New« (ny) b) en ændring af en tidligere indberettet værdipapirfinansieringstransaktion betegnes som »Modification« (ændring). Dette omfatter en ajourføring af en tidligere indberetning, som viser en position, med henblik på at afspejle nye transaktioner, som indgår i den pågældende position c) en værdiansættelse af værdipapiret eller råvaren, der er omfattet af en transaktion med udlån af værdipapirer eller varer, identificeres som »Collateral update« (ajourføring af sikkerhedsstillelse)	Y	Y	Y	Y

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
		<p>d) en ændring af oplysningerne om data om sikkerhedsstillelse, herunder værdiansættelsen, identificeres som »Collateral update« (ajourføring af sikkerhedsstillelse)</p> <p>e) en annullering af en fejlagtigt indgivet fuldstændig indberetning, hvor værdipapirfinansieringstransaktionen aldrig blev indgået eller ikke var omfattet af indberetningskravene for værdipapirfinansieringstransaktioner, men som blev indberettet til et transaktionsregister ved en fejl, identificeres i så fald som »Error« (fejl)</p> <p>f) en korrektion af datafelter, der blev indgivet forkert i en tidligere indberetning, identificeres som »Correction« (korrektion)</p> <p>g) en ophævelse af en værdipapirfinansieringstransaktion uden fastsat løbetid eller en førtidig ophævelse af en værdipapirfinansieringstransaktion med fastsat løbetid identificeres som »Termination/Early termination« (ophævelse/førtidig ophævelse)</p> <p>h) en værdipapirfinansieringstransaktion, der skal indberettes som en ny transaktion og også indgå i en særskilt positionsindberetning den samme dag, identificeres som »Position component« (positions-komponent).</p>				
99	Niveau	<p>Angivelse af, om indberetningen sker på transaktions- eller positionsniveau.</p> <p>Indberetning på positionsniveau kan udelukkende anvendes som et supplement til indberetning på transaktionsniveau med henblik på at indberette efterfølgende transaktionshændelser og udelukkende, hvis de individuelle transaktioner i fungible produkter er erstattet af en position.</p>	Y	Y	Y	N

Tabel 3

Margendata

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
1	Tidsstempel for indberetningen	Dato og klokkeslæt for indberetning til transaktionsregistret.	Y	Y	Y	N
2	Dato for hændelsen	Dato, på hvilken den indberetningspligtige hændelse, der vedrører værdipapirfinansieringstransaktionen, og som fremgår af indberetningen, fandt sted. For handlingstyperne »Valuation update« (værdiajourføring), »Collateral update« (ajourføring af sikkerhedsstillelse), »Reuse update« (ajourføring af genanvendelse), »Margin update« (ajourføring af margen) den dato, for hvilken de indberettede oplysninger anføres.	Y	Y	Y	N
3	Indberettende enhed	Entydig identifikationskode for den indberettende enhed. Hvis indgivelsen af indberetningen er delegeret til en tredjepart eller til den anden modpart, den entydige identifikationskode for denne enhed.	Y	Y	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
4	Indberettende modpart	Entydig identifikationskode for den indberettende modpart.	Y	Y	Y	N
5	Enhed, der er ansvarlig for indberetningen	<p>Hvis en finansiel modpart er ansvarlig for indberetningen på den anden modparts vegne i henhold til artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365, den entydige identifikationskode for denne finansielle modpart.</p> <p>Hvis et administrationselskab er ansvarligt for indberetningen på vegne af et institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) i henhold til artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365, den entydige identifikationskode for dette administrationselskab.</p> <p>Hvis en forvalter af alternative investeringsfonde (FAIF'er) er ansvarlig for indberetningen på vegne af en alternativ investeringsfond (AIF) i henhold til artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365, den entydige identifikationskode for denne FAIF.</p>	Y	Y	Y	Y
6	Anden modpart	Den entydige identifikationskode for den enhed, med hvilken den indberettende modpart har indgået en værdipapirfinansieringstransaktion.	Y	Y	Y	N
7	Porteføljekode	<p>Porteføljen af transaktioner, for hvilke der udveksles margener, identificeres ved en entydig kode af den indberettende modpart.</p> <p>Hvis porteføljen af transaktioner også indeholder derivatavtaler, der er indberettelsespligtige i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012, skal porteføljekoden være den samme som den, der blev indberettet i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012.</p>	Y	Y	Y	N
8	Stillet initialmargin	<p>Værdi af den initialmargin, som den indberettende modpart har stillet over for den anden modpart.</p> <p>Hvis initialmarginen stilles på porteføljebasis, anføres værdien af hele den initialmargin, der stilles for porteføljen, i dette felt.</p>	Y	Y	Y	N
9	Valuta for den stillede initialmargin	Valuta for den stillede initialmargin	Y	Y	Y	N
10	Stillet variationsmargin	<p>Værdi af den variationsmargin, herunder også værdien af afviklede kontantbeløb, som den indberettende modpart har stillet over for den anden modpart.</p> <p>Hvis variationsmarginen stilles på porteføljebasis, anføres hele værdien af den variationsmargin, der stilles for porteføljen, i dette felt.</p>	Y	Y	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
11	Valuta for den stillede variationsmargin	Valuta for den stillede variationsmargin.	Y	Y	Y	N
12	Modtaget initialmargin	Værdi af den initialmargin, som den indberettende modpart har modtaget fra den anden modpart. Hvis initialmarginen modtages på porteføljebasis, anføres hele værdien af den initialmargin, der modtages for porteføljen, i dette felt.	Y	Y	Y	N
13	Valuta for den modtagne initialmargin	Valuta for den modtagne initialmargin.	Y	Y	Y	N
14	Modtaget variationsmargin	Værdi af den variationsmargin, herunder også værdien af afviklede kontantbeløb, som den indberettende modpart har modtaget fra den anden modpart. Hvis variationsmarginen modtages på porteføljebasis, anføres hele værdien af den variationsmargin, der modtages for porteføljen, i dette felt.	Y	Y	Y	N
15	Valuta for den modtagne variationsmargin	Valuta for den modtagne variationsmargin.	Y	Y	Y	N
16	Overskydende stillet sikkerhed	Værdi af sikkerhed stillet ud over den krævede sikkerhed.	Y	Y	Y	N
17	Valuta for den overskydende stillede sikkerhed	Valuta for den overskydende stillede sikkerhed.	Y	Y	Y	N
18	Overskydende modtaget sikkerhedsstillelse	Værdi af sikkerhed modtaget ud over den krævede sikkerhedsstillelse.	Y	Y	Y	N
19	Valuta for den overskydende modtagne sikkerhedsstillelse	Valuta for den overskydende modtagne sikkerhedsstillelse	Y	Y	Y	N
20	Handlingstype	Indberetningen skal indeholde én af de følgende handlingstyper: a) en ny margensaldo identificeres som »New« (ny) b) en ændring af oplysningerne om margenerne identificeres som »Margin update« (ajourføring af margen)	Y	Y	Y	N

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
		c) en annullering af en fejlagtigt indgivet fuldstændig indberetning, identificeres som »Error« (fejl) d) en korrektion af datafelter, der blev indgivet forkert i en tidligere indberetning, identificeres som »Correction« (korrektion)				

Tabel 4

Data om genanvendelse, geninvestering af kontantbeløb og finansieringskilder

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
1	Tidsstempel for indberetningen	Dato og klokkeslæt for indberetning til transaktionsregistret.	Y	Y	Y	Y
2	Dato for hændelsen	Dato, på hvilken den indberetningspligtige hændelse, der vedrører værdipapirfinansieringstransaktionen, og som fremgår af indberetningen, fandt sted. For handlingstyperne »Valuation update« (værdiajourføring), »Collateral update« (ajourføring af sikkerhedsstillelse), »Reuse update« (ajourføring af genanvendelse), »Margin update« (ajourføring af margen) den dato, for hvilken de indberettede oplysninger anføres.	Y	Y	Y	Y
3	Indberettende enhed	Entydig identifikationskode for den indberettende enhed. Hvis indgivelsen af indberetningen er delegeret til en tredjepart eller til den anden modpart, den entydige identifikationskode for denne enhed.	Y	Y	Y	Y
4	Indberettende modpart	Entydig identifikationskode for den indberettende modpart.	Y	Y	Y	Y
5	Enhed, der er ansvarlig for indberetningen	Hvis en finansiel modpart er ansvarlig for indberetningen på den anden modparts vegne i henhold til artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365, den entydige identifikationskode for denne finansielle modpart. Hvis et administrationsselskab er ansvarligt for indberetningen på vegne af et institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) i henhold til artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365, den entydige identifikationskode for dette administrations-selskab. Hvis en forvalter af alternative investeringsfonde (FAIF'er) er ansvarlig for indberetningen på vegne af en alternativ investeringsfond (AIF) i henhold til artikel 4, stk. 3, i forordning (EU) 2015/2365, den entydige identifikationskode for denne FAIF.	Y	Y	Y	Y

Felt 6 gentages og udfyldes for hver enkelt sikkerhedsstillelseskomponent

6	Type sikkerhedsstillelseskomponent	Angivelse af typen af sikkerhedsstillelseskomponenter	Y	Y	Y	Y
---	------------------------------------	---	---	---	---	---

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
-----	------	-----------------------------------	------	-----	----	----

Felt 7, 8, 9 og 10 gentages og udfyldes for hvert enkelt værdipapir.

7	Sikkerhedsstillelseskomponent	Identifikation af det værdipapir, der er stillet som sikkerhed.	Y	Y	Y	Y
8	Værdi af den genanvendte sikkerhedsstillelse	Den samlede værdi af den genanvendte sikkerhedsstillelse, når den kan beregnes for værdipapirfinansieringstransaktionen på transaktionsniveau.	Y	Y	Y	Y
9	Anslået genanvendelse af sikkerhedsstillelsen	Når den faktiske værdi af den genanvendte sikkerhedsstillelse er ukendt eller ikke kan beregnes, beregnes den anslåede værdi af genanvendelsen for det enkelte finansielle instruments vedkommende i henhold til FSB's rapport Transforming Shadow Banking into Resilient Market-based Finance, Non-Cash Collateral Re-Use»: Measure and Metrics« af 25. januar 2017.	Y	Y	Y	Y
10	Valuta for genanvendt sikkerhedsstillelse	Valuta for den faktiske eller anslåede værdi af den genanvendte sikkerhedsstillelse.	Y	Y	Y	Y
11	Geninvesteringssats	Gennemsnitlig rentesats, der modtages fra en geninvestering af kontant sikkerhedsstillelse, der er foretaget af långiveren.	N	N	Y	N

Felt 12, 13 og 14 gentages og udfyldes for hver investering, hvor den kontante sikkerhedsstillelse er blevet geninvesteret, og for hver valuta

12	Type geninvesteret kontant sikkerhedsstillelse	Geninvesteringstype.	N	N	Y	N
13	Geninvesteret kontantbeløb	Det geninvesterede kontantbeløb i en given valuta.	N	N	Y	N
14	De geninvesterede kontanters valuta	Valuta for geninvesterede kontanter.	N	N	Y	N

For margenudlånstransaktioner gentages og udfylder modparten felt 15, 16 og 17 for hver finansieringskilde og giver oplysningerne i disse felter på enhedsniveau.

15	Finansieringskilder	Finansieringskilder anvendt til at finansiere margenudlån.	N	N	N	Y
16	Finansieringskildernes markedsværdi	Finansieringskildernes markedsværdi nævnt i felt 15.	N	N	N	Y
17	Finansieringskildernes valuta	Valutaen for finansieringskildernes markedsværdi.	N	N	N	Y
18	Handlingstype	Indberetningen skal indeholde én af de følgende handlingstyper: a) en ny saldo for genanvendelse identificeres som »New« (ny)	Y	Y	Y	Y

Nr.	Felt	Oplysninger, der skal indberettes	Repo	BSB	SL	ML
		b) en ændring af oplysningerne om genanvendelsen identificeres som »Reuse update« (ajourføring af genanvendelse) c) en annullering af en fejlagtigt indgivet fuldstændig indberetning, identificeres som »Error« (fejl) d) en korrektion af datafelter, der blev indgivet forkert i en tidligere indberetning, identificeres som »Correction« (korrektion)				