

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2019/358**av den 13 december 2018****om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 vad gäller tekniska tillsynsstandarder för transaktionsregisters insamling, kontroll, aggregering, jämförande och offentliggörande av uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering****(Text av betydelse för EES)**

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 av den 25 november 2015 om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering och om återanvändning samt om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 ⁽¹⁾, särskilt artiklarna 5.7 a och 12.3 a och b, och

av följande skäl:

- (1) För att säkerställa att de uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som rapporteras till transaktionsregister har hög kvalitet bör transaktionsregister kontrollera de rapportinlämnande enheternas identitet, den logiska tillförlitligheten hos den följd i vilken uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering rapporteras och dessa uppgifters fullständighet och korrekthet.
- (2) Av samma skäl bör transaktionsregister stämma av uppgifterna i varje rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering som mottas. Det bör införas en standardiserad process för att transaktionsregister ska kunna genomföra avstämningar på ett konsekvent sätt och för att minska risken för att uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering inte stäms av. Vissa uppgifter om sådana transaktioner kanske emellertid inte är identiska till följd av särdragen hos de tekniska system som de rapportinlämnande enheterna använder. Vissa toleranser bör således godtas så att smärre skillnader i inrapporterade uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering inte hindrar myndigheterna från att analysera uppgifterna med en tillräcklig konfidensgrad.
- (3) De rapportinlämnande enheterna väntas med tiden förbättra sin rapportering, både i fråga om en minskning av antalet avvisade rapporter och i fråga om avstämda rapporter. De bör emellertid ges tillräckligt med tid att anpassa sig till rapportkraven, i synnerhet för att förhindra en ansamling av icke-avstämde transaktioner omedelbart efter det att rapportkraven börjar gälla. Följaktligen bör enbart en begränsad mängd fält stämmas av i en första fas.
- (4) De rapportinlämnande enheterna och, i tillämpliga fall, de enheter som ansvarar för rapportering bör kunna övervaka sin efterlevnad av rapportkraven enligt förordning (EU) 2015/2365. De bör således få tillgång till viss information på daglig basis om de berörda rapporterna, inbegripet resultatet av kontrollen av dessa rapporter, och framstegen i avstämningen av rapporterade uppgifter. Det är följaktligen nödvändigt att ange vilken information som transaktionsregister bör göra tillgänglig för dessa enheter vid slutet av varje arbetsdag.
- (5) För att stärka tillförlitligheten hos uppgifterna om transaktioner för värdepappersfinansiering bör den direkta och omedelbara tillgång som avses i artikel 12.2 i förordning (EU) 2015/2365 ges på ett harmoniserat och konsekvent sätt. För att få standardiserad rapportering, minimera branschens kostnader och se till att uppgifterna från olika transaktionsregister är jämförbara och aggregerade på ett konsekvent sätt bör samtliga utdatarapporter och utbyten skickas i mallar i xml-format och följa en metod som används allmänt i finansbranschen.
- (6) För att de enheter som avses i artikel 12.2 i förordning (EU) 2015/2365 ska kunna bedöma om det föreligger potentiella källor till systemrisk eller icke-systemrisk för den finansiella stabiliteten är det nödvändigt att de får tillgång till uppgifter på positionsnivå om exponeringar mellan två givna motparter.
- (7) För att allmänheten ska få tillräckligt transparenta uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering bör kriterierna för aggregering av positioner möjliggöra för allmänheten att förstå hur marknaderna för sådana

⁽¹⁾ EUTL 337, 23.12.2015, s. 1.

transaktioner fungerar, utan att konfidentialiteten hos de uppgifter som rapporteras till transaktionsregistren undergrävs. Den frekvens med vilken ett transaktionsregister ska offentliggöra aggregerade positioner och detaljnivån på dessa uppgifter enligt artikel 12.1 i förordning (EU) 2015/2365 bör anges på ett sätt som bygger på den relaterade ram som i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012^(?) föreskrivs för derivatkontrakt.

- (8) Denna förordning baseras på det förslag till tekniska tillsynsstandarder som Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten (Esma) lämnat till kommissionen i enlighet med förfarandet i artikel 10 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010^(?).
- (9) Bestämmelserna i denna förordning behandlar operativa standarder för transaktionsregisters insamling, aggregering och jämförande av uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering samt de förfaranden som de ska använda för att kontrollera att de uppgifter om sådana transaktioner som rapporteras till dem är fullständiga och korrekta. För att säkerställa konsekvens mellan dessa bestämmelser och underlätta en heltäckande överblick för transaktionsregistren är det önskvärt att de berörda tekniska tillsynsstandarderna samlas i en enda förordning.
- (10) Esma har genomfört öppna offentliga samråd om förslaget till tekniska tillsynsstandarder, har analyserat de möjliga kostnaderna och fördelarna i sammanhanget och har begärt ett yttrande från den intressentgrupp för värdepapper och marknader som inrättats i enlighet med artikel 37 i förordning (EU) nr 1095/2010.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Transaktionsregisters kontroll av rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering

1. Ett transaktionsregister ska kontrollera följande i en mottagen rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering:
 - (a) Identiteten för den rapportinlämnande enheten enligt fält 2 i tabell 1 i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2019/363^(*).
 - (b) Att den xml-mall som använts för att rapportera en transaktion för värdepappersfinansiering motsvarar ISO 20022-metoden i enlighet med genomförandeförordning (EU) 2019/363.
 - (c) Att den rapportinlämnande enheten, om annan än den rapporterande motpart som avses i fält 3 i tabell 1 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2019/363, har vederbörlig befogenhet att rapportera på den rapporterande motpartens vägnar, utom i de fall som avses i artikel 4.3 i förordning (EU) 2015/2365.
 - (d) Att samma rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering inte har lämnats tidigare.
 - (e) Att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "Ändring" avser en tidigare inlämnad rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering.
 - (f) Att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "Ändring" inte avser en transaktion för värdepappersfinansiering som har rapporterats som annullerad.
 - (g) Att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering inte innefattar åtgärdstypen "Ny" i fråga om en transaktion för värdepappersfinansiering som redan har rapporterats.
 - (h) Att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering inte innefattar åtgärdstypen "Positionskomponent" i fråga om en transaktion för värdepappersfinansiering som redan har rapporterats.

^(?) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 av den 4 juli 2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister (EUT L 201, 27.7.2012, s. 1).

^(?) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/77/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 84).

^(*) Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2019/363 av den 13 december 2018 om fastställande av tekniska genomförandestandarder för form och frekvens för rapportering om detaljer om transaktioner för värdepappersfinansiering till transaktionsregister i enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 och om ändring av kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 vad gäller användning av rapporteringskoder vid rapportering av derivatkontrakt (se sidan 85 i detta nummer av EUT).

- (i) Att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering inte avser att ändra uppgifter om den rapportinlämnande enheten, den rapporterade motparten eller den andra motparten till en tidigare rapporterad transaktion för värdepappersfinansiering.
 - (j) Att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering inte avser att ändra en befintlig rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering genom att ange en valuteringsdag som infaller efter den rapporterade förfallodagen för en transaktion för värdepappersfinansiering.
 - (k) Att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering är korrekt och fullständig.
2. Ett transaktionsregister ska kontrollera om information om säkerheter har rapporterats i fälten 73–96 i tabell 2 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2019/363 när det gäller sådana transaktioner för värdepappersfinansiering där fält 72 "Indikator för värdepappersfinansiering utan säkerhet" i samma tabell innehåller uppgiften "felaktig". Transaktionsregistret ska i enlighet med artikel 3 i denna förordning meddela den rapportinlämnande enheten, den rapporterade motparten och, i tillämpliga fall, den enhet som ansvarar för rapportering resultaten av kontrollen.
3. Ett transaktionsregister ska avvisa en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering som inte uppfyller något av kraven i punkt 1 och hänföra den till någon av de avvisningskategorier som anges i tabell 2 i bilaga I till denna förordning.
4. Inom 60 minuter efter mottagandet av en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering ska ett transaktionsregister lämna detaljerad information om resultaten av den uppgiftskontroll som avses i punkt 1 till den rapportinlämnande enheten, den rapporterade motparten och, i tillämpliga fall, den enhet som ansvarar för rapportering. Transaktionsregistret ska tillhandahålla dessa resultat i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden. Resultaten ska i tillämpliga fall inbegripa de specifika skälen till att en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering har avvisats i enlighet med punkt 3.

Artikel 2

Transaktionsregisters avstämning av uppgifter

1. Ett transaktionsregister ska sträva efter att stämma av en rapporterad transaktion för värdepappersfinansiering genom att följa de steg som anges i punkt 2, under förutsättning att samtliga följande villkor är uppfyllda:
- (a) Transaktionsregistret har fullbordat de kontroller som anges i artikel 1.1 och 1.2.
 - (b) Båda motparter till den rapporterade transaktionen för värdepappersfinansiering har rapporteringsskyldighet.
 - (c) Transaktionsregistret har inte mottagit en efterföljande rapport med åtgärdstypen "Fel" i fråga om den rapporterade transaktionen för värdepappersfinansiering.
2. Om samtliga villkor i punkt 1 är uppfyllda ska ett transaktionsregister följa följande steg, utgående från det senast rapporterade värdet för vart och ett av fälten i tabell 1 i bilaga I till denna förordning:
- (a) Ett transaktionsregister som mottagit en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering ska kontrollera om det har mottagit en motsvarande rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering från den andra motparten eller för dennes räkning.
 - (b) Ett transaktionsregister som inte har mottagit en motsvarande rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering enligt led a ska försöka att identifiera det transaktionsregister som har mottagit den motsvarande rapporten om transaktioner för värdepappersfinansiering genom att till samtliga registrerade transaktionsregister meddela värdena för följande fält i den rapporterade transaktionen för värdepappersfinansiering: "Unik transaktionsidentifierare", "Rapporterande motpart", "Andra motpart" och "Ramavtalstyp".
 - (c) Ett transaktionsregister som fastställer att ett annat transaktionsregister har mottagit en motsvarande rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering enligt led a ska med detta transaktionsregister utbyta närmare uppgifter om den rapporterade transaktionen för värdepappersfinansiering i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden.
 - (d) Om inte annat sägs i led e ska ett transaktionsregister betrakta en rapporterad transaktion för värdepappersfinansiering som avstämd när de närmare uppgifterna om den transaktionen matchar de närmare uppgifterna i rapporten om den motsvarande transaktionen för värdepappersfinansiering enligt led a.
 - (e) Ett transaktionsregister ska försöka att separat matcha fälten rörande uppgifter om lån och fälten rörande uppgifter om säkerheter för en rapporterad transaktion för värdepappersfinansiering i enlighet med de toleransgränser och berörda tillämpningsdagar som anges i tabell 1 i bilaga I till denna förordning.

- (f) Ett transaktionsregister ska därefter tilldela varje rapporterad transaktion för värdepappersfinansiering värden från avstämningskategorierna enligt tabell 3 i bilaga I till denna förordning.
- (g) Ett transaktionsregister ska slutföra stegen i leden a–f så snabbt som möjligt och får inte följa något av dessa steg igen efter kl. 18.00 koordinerad universell tid (UTC) på en given arbetsdag.
- (h) Ett transaktionsregister som inte kan stämma av en rapporterad transaktion för värdepappersfinansiering ska försöka att matcha de närmare uppgifterna om den rapporterade transaktionen påföljande arbetsdag. Transaktionsregistret ska upphöra att försöka stämma av den rapporterade transaktionen 30 kalenderdagar efter den rapporterade förfallodagen för transaktionen eller efter det att transaktionsregistret har mottagit en rapport avseende transaktionen med åtgärdstypen "Avslutande" eller "Positionskomponent".
3. Ett transaktionsregister ska vid varje arbetsdags utgång bekräfta det totala antalet avstämda rapporterade transaktioner för värdepappersfinansiering med varje transaktionsregister med vilket det har stämt av rapporterade transaktioner för värdepappersfinansiering.
4. Senast 60 minuter efter det att avstämningsprocessen enligt punkt 2 g har avslutats ska ett transaktionsregister meddela resultaten av den avstämmning som det utfört avseende rapporterade transaktioner för värdepappersfinansiering till den rapportinlämnande enheten, den rapporterande motparten och, i tillämpliga fall, den enhet som ansvarar för rapportering. Transaktionsregistret ska tillhandahålla dessa resultat i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden, inklusive information om de fält som inte har stämts av.

Artikel 3

Svarssystem vid dagens slut

Vid slutet av varje arbetsdag ska ett transaktionsregister för den rapportinlämnande enheten, den rapporterande motparten och, i tillämpliga fall, den enhet som ansvarar för rapportering göra tillgänglig följande information om berörda transaktioner för värdepappersfinansiering i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden:

- (a) De transaktioner för värdepappersfinansiering som rapporterats under dagen.
- (b) Den senaste transaktionsstatusen för de transaktioner för värdepappersfinansiering som inte har förfallit eller för vilka rapporter med åtgärdstyperna "Fel", "Avslutande" eller "Positionskomponent" inte har lämnats.
- (c) Den unika transaktionsidentifieraren för de transaktioner för värdepappersfinansiering där fält 72 i tabell 2 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2019/363 innehåller uppgiften "felaktig", och för vilka information om säkerheter i fälten 73–96 i samma tabell ännu inte har rapporterats.
- (d) De rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering som har avvisats under dagen.
- (e) Avstämningsstatusen för samtliga rapporterade transaktioner för värdepappersfinansiering, utom de som har löpt ut eller för vilka rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering med åtgärdstypen "Avslutande" eller "Positionskomponent" mottogs över en månad före den arbetsdagen.

Artikel 4

Tillgång till uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering

Ett transaktionsregister ska ge de enheter som anges i artikel 12.2 i förordning (EU) 2015/2365 direkt och omedelbar tillgång, även när delegering enligt artikel 28 i förordning (EU) nr 1095/2010 föreligger, till uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering i elektronisk och maskinläsbar form i enlighet med kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/357⁽⁵⁾.

Vid tillämpning av första stycket ska transaktionsregistret använda formatet xml och en mall som utarbetats enligt ISO 20022-metoden.

⁽⁵⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/357 av den 13 december 2018 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 vad gäller tekniska standarder för tillsyn i fråga om tillgång till uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som är registrerade i transaktionsregister (se sidan 22 i detta nummer av EUT).

Artikel 5

Beräkning av och tillgång till uppgifter på positionsnivå

1. Ett transaktionsregister ska beräkna uppgifter på positionsnivå om exponeringar mellan motparter när det gäller lån och säkerheter. Beräkningen av uppgifter på positionsnivå ska baseras på följande kriterier:
 - (a) Värderna på avstämningskategorierna, enligt tabell 3 i bilaga I till denna förordning.
 - (b) Typ av transaktion för värdepappersfinansiering.
 - (c) Motparternas sektor.
 - (d) Clearingstatus.
 - (e) På eller utanför en handelsplats.
 - (f) Typ av säkerhet.
 - (g) Valuta för kontantdelen.
 - (h) Löptidsintervall.
 - (i) Intervall för värderingsavdrag.
 - (j) De transaktionsregister till vilka den andra motparten rapporterat uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering.
2. Ett transaktionsregister ska säkerställa att de enheter som anges i artikel 12.2 i förordning (EU) 2015/2365 har tillgång till uppgifter på positionsnivå motsvarande den tillgång till uppgifter som föreskrivs i delegerad förordning (EU) 2019/357.
3. De uppgifter på positionsnivå som avses i punkt 1 ska tillhandahållas i elektronisk och maskinläsbar form i ett xml-format och med hjälp av en mall som utarbetats i enlighet med ISO 20022-metoden.
4. Den tillgång som avses i punkt 2 ska ges så snabbt som möjligt och senast arbetsdagen efter mottagandet av en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering enligt artikel 4.1 i förordning (EU) 2015/2365.
5. Ett transaktionsregister ska ge de enheter som anges i artikel 12.2 i förordning (EU) 2015/2365 tillgång till uppgifter på aggregerad nivå, som motsvarar den tillgång till uppgifter som föreskrivs i delegerad förordning (EU) 2019/357 och som beräknas i enlighet med gemensamt överenskomna standarder och processer för global insamling och aggregering av uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering.

Artikel 6

Beräkning av uppgifter om aggregerade positioner för offentliggörande

1. Ett transaktionsregister ska aggregera uppgifter om positioner enligt kriterierna i punkterna 2 och 3 när det gäller följande värden:
 - (a) Säkerställt belopp för återköpsavtal, köp- och återförsäljningstransaktioner eller sälj- och återköpstransaktioner, aggregerad volym av värdepapper eller råvaror som lånats in eller lånats ut och beloppet av marginallån.
 - (b) Antalet unika transaktionsidentifikatorer som avser de berörda transaktionerna för värdepappersfinansiering.
 - (c) Säkerhetens marknadsvärde.
2. Transaktionsregistret ska aggregera uppgifter om positioner i fråga om samtliga transaktioner för värdepappersfinansiering som rapporterats med åtgärdstypen "Ny" mellan lördag kl. 00:00:00 UTC och fredag kl. 23:59:59 UTC, på grundval av följande kriterier och de relaterade värden som anges i tabell 1 i bilaga II till denna förordning:
 - (a) Hemvist för den rapporterade motparten eller, i tillämpliga fall, den relevanta filialen.
 - (b) Hemvist för den andra motparten eller, i tillämpliga fall, den relevanta filialen.
 - (c) Typ av transaktion för värdepappersfinansiering.
 - (d) Avstämningsstatus för transaktionen för värdepappersfinansiering enligt tabell 3 i bilaga I till denna förordning.

- (e) Typ av plats på vilken transaktionen för värdepappersfinansiering ingicks.
 - (f) Huruvida transaktionen för värdepappersfinansiering har clearats eller ej.
 - (g) Metod för överföring av säkerheten.
 - (h) Varje index som använts som referens i en transaktion för värdepappersfinansiering och som varit föremål för handel på en annan handelsplats än "XXXX", när det aggregerade nominella belopp som rapporterats till transaktionsregistret i indexet överskrider 5 miljarder euro och minst sex olika motparter har rapporterat de relevanta transaktionerna för värdepappersfinansiering till transaktionsregistret.
3. Transaktionsregistret ska aggregera uppgifter om positioner i fråga om samtliga transaktioner för värdepappersfinansiering som inte har förfallit eller för vilka rapporter med åtgärdstyperna "Fel", "Avslutande" eller "Positionskomponent" inte har mottagits senast fredag kl. 23:59:59 UTC, på grundval av följande kriterier och de relaterade värden som anges i tabell 1 i bilaga II till denna förordning:
- (a) Hemvist för den rapporterande motparten eller, i tillämpliga fall, den relevanta filialen.
 - (b) Hemvist för den andra motparten eller, i tillämpliga fall, den relevanta filialen.
 - (c) Typ av transaktion för värdepappersfinansiering.
 - (d) Avstämningsstatus för transaktionen för värdepappersfinansiering enligt tabell 3 i bilaga I till denna förordning.
 - (e) Typ av plats på vilken transaktionen för värdepappersfinansiering ingicks.
 - (f) Huruvida transaktionen för värdepappersfinansiering har clearats eller ej.
 - (g) Metod för överföring av säkerheten.
 - (h) Varje index som använts som referens i en transaktion för värdepappersfinansiering och som varit föremål för handel på en annan handelsplats än "XXXX", när det aggregerade nominella belopp som rapporterats till transaktionsregistret i indexet överskrider 5 miljarder euro och minst sex olika motparter har rapporterat de relevanta transaktionerna för värdepappersfinansiering till transaktionsregistret.
4. Ett transaktionsregister ska ha ett förfarande för att identifiera ovanliga värden avseende uppgifterna om aggregerade positioner.
5. Ett transaktionsregister ska ha ett förfarande för att utföra och meddela rättelser av uppgifter om aggregerade positioner, inbegripet de som härrör från rapporter med åtgärdstypen "Fel", och för att offentliggöra ursprungliga och rättade aggregeringar av uppgifter.

Artikel 7

Offentliggörande av uppgifter om aggregerade positioner

1. Ett transaktionsregister ska varje vecka senast tisdagar kl. 12.00 på sin webbplats offentliggöra uppgifter om aggregerade positioner, beräknade i enlighet med artikel 6, när det gäller sådana transaktioner för värdepappersfinansiering som rapporterats senast kl. 23:59:59 UTC på föregående fredagar.
2. Transaktionsregistret ska offentliggöra samtliga uppgifter om aggregerade positioner i euro och använda de växelkurser som offentliggjorts på Europeiska centralbankens webbplats på de fredagar som föregår offentliggörandet av uppgifterna.
3. Transaktionsregistret ska säkerställa att uppgifterna om aggregerade positioner offentliggörs i tabellform enligt bilaga II till denna förordning och på ett sätt som medger nedladdning av uppgifterna.
4. De uppgifter om aggregerade positioner som transaktionsregistret har offentliggjort på sin webbplats ska finnas kvar på webbplatsen under minst 104 veckor.

Artikel 8

Ikraftträdande

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Den är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

Utfärdad i Bryssel den 13 december 2018.

På kommissionens vägnar

Jean-Claude JUNCKER

Ordförande

BILAGA I

Tabell 1

Fält för avstämning, toleransnivåer och startdagar för avstämningen

Tabell	Avsnitt	Fält	Tolerans	Startdag enligt
Uppgifter om motpart	Ej tillämpligt	Rapporterande motpart	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Uppgifter om motpart	Ej tillämpligt	Motparts sida	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Uppgifter om motpart	Ej tillämpligt	Annan motpart	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Unikt transaktions-ID (UTI)	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Typ av transaktion för värdepappersfinansiering	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Clearat	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Clearingtidpunkt	En timme	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsuppgifter	Lån	Central motpart	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Handelsplats	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Ramavtalstyp	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Genomförande-tidpunkt	En timme	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Valuteringsdag (startdatum)	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Förfallodag (slutdatum)	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Avslutandedag	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsuppgifter	Lån	Minimiuppsägningstid	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsuppgifter	Lån	Tidigaste återkallelsedag	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsuppgifter	Lån	Indikator för allmän säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader

Tabell	Avsnitt	Fält	Tolerans	Startdag enligt
Transaktionsavgifter	Lån	Indikator för "delivery by value"	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Metod för säkerhetsställande	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Utan fastställd löptid	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Frivilligt avslutande	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Fast ränta	Upp till 3:e siffran efter decimaltecknet	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Dagberäkningsmetod	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Rörlig ränta	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Referensperiod för rörlig ränta – periodangivelse	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Referensperiod för rörlig ränta – multiplikator	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Betalningsfrekvens för rörlig ränta – periodangivelse	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Betalningsfrekvens för rörlig ränta – multiplikator	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Justeringsfrekvens för rörlig ränta – periodangivelse	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Justeringsfrekvens för rörlig ränta – multiplikator	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Spread	Upp till 3:e siffran efter decimaltecknet	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Valutabelopp för marginalutlåning	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Valuta för marginalutlåning	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365

Tabell	Avsnitt	Fält	Tolerans	Startdag enligt
Transaktionsavgifter	Lån	Justerad sats	Upp till 3:e siffran efter decimaltecknet	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Räntedatum	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Kapitalbelopp på valuteringsdagen	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Kapitalbelopp på förfallodagen	0,0005 %	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Valuta för kapitalbelopp	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Typ av tillgång	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Identifiering av värdepapper	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Klassificering av ett värdepapper	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Basprodukt	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Underprodukt	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Ytterligare underprodukt	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Volym eller nominellt belopp	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Måttenhet	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Valuta för nominellt belopp	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Pris på värdepapper eller råvara	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Valuta för pris	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Kvalitet på värdepapper	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Värdepapperets löptid	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365

Tabell	Avsnitt	Fält	Tolerans	Startdag enligt
Transaktionsavgifter	Lån	Emittentens jurisdiktion	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Emittentens LEI-kod (identifieringskod för juridiska personer)	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Typ av värdepapper	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Lånebelopp	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Marknadsvärde	0,0005 %	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Sats för fast rabatt	Upp till 3:e siffran efter decimaltecknet	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Sats för rörlig rabatt	Upp till 3:e siffran efter decimaltecknet	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Referensperiod för sats för rörlig rabatt – periodangivelse	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Referensperiod för sats för rörlig rabatt – multiplikator	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Betalningsfrekvens för sats för rörlig rabatt – periodangivelse	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Betalningsfrekvens för sats för rörlig rabatt – multiplikator	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Justeringsfrekvens för sats för rörlig rabatt – periodangivelse	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Justeringsfrekvens för sats för rörlig rabatt – multiplikator	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Rabattsatsens spread	Upp till 3:e siffran efter decimaltecknet	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Låneavgift	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365

Tabell	Avsnitt	Fält	Tolerans	Startdag enligt
Transaktionsavgifter	Lån	Exklusiva arrangemang	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Lån	Utestående marginallån	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Basvaluta för utestående marginallån	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Marknadsvärde på korta positioner	0,0005 %	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Indikator för värdepapperslån utan säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Kollateralisering av nettoexponering	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Valuteringsdag för säkerheten	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Typ av säkerhetskomponent	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Belopp av kontantsäkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Valuta för kontantsäkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Identifiering av ett värdepapper som används som säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Klassificering av ett värdepapper som används som säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Basprodukt	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Underprodukt	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Ytterligare underprodukt	Nej	Artikel 33.2 a iv i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Volym eller nominellt belopp av säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Måttenhet för säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader

Tabell	Avsnitt	Fält	Tolerans	Startdag enligt
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Valuta för nominellt belopp av säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Valuta för pris	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Pris per enhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Marknadsvärde på säkerhet	0,0005 %	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365 + 24 månader
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Värderingsavdrag eller marginal	Upp till 3:e siffran efter decimaltecknet	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Kvalitet på säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Förfallodag för värdepapper	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Emittentens jurisdiktion	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Emittentens LEI-kod (identifieringskod för juridiska personer)	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Typ av säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Möjlighet till återanvändning av säkerhet	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Säkerhet	Identifiering av korg av säkerheter	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365
Transaktionsavgifter	Lån	Nivå	Nej	Artikel 33.2 a i i förordning (EU) 2015/2365

Tabell 2

Skäl till avvisande av en rapport om transaktioner för värdepappersfinansiering

Avvisningskategorier	Skäl
Databasschema	— Transaktionen för värdepappersfinansiering avvisas eftersom databasschemat inte uppfyller villkoren
Rättigheter	— Transaktionen för värdepappersfinansiering avvisas eftersom den rapportinlämnande enheten inte får rapportera för den rapporterande motpartens räkning
Logik	— Transaktionen för värdepappersfinansiering avvisas eftersom åtgärdstypen för transaktionen inte är logiskt korrekt
Affärsrelaterat	— Transaktionen för värdepappersfinansiering avvisas eftersom den inte uppfyller villkoren för en eller flera innehållsrelaterade valideringar

Tabell 3

Resultat av avstämningsprocessen

Avstämningskategorier	Avstämningsvärden
Rapporttyp	Enpartsrapportering/Tvåpartsrapportering
Rapporteringsskyldighet för båda motparter	Ja/Nej
Matchningsstatus	Matchat/Ej matchat
Lån – avstämningsstatus	Avstämt/Ej avstämt
Säkerheter – avstämningsstatus	Avstämt/Ej avstämt
Ytterligare ändringar	Ja/Nej

Tabell 1

Offentliga uppgifter

Tabell A. Aggregering

Datum	Tr	Typ av aggregering	Typ av handels-plats	Hemvist för rapporte-rande motpart	Hemvist för den andra motparten	Avstämning	Typ av transaktion för värdepappers-finansiering	Clearad	Metod för överföring av säkerhet	Index använt som referens ⁽¹⁾	Totalt utlånat belopp	Totalt antal trans-aktioner	Samlat värde på säkerheter
20161007	EU TR	Rapporte-rad	XXXX	EES	EES	Tvåparts-rapporter-ing, lån avstämt, sä-kerhet ej avstämd	Repa	Ja	TTCA	
...	...	Utestå-ende	XOFF	Ej EES	Ej EES	Tvåparts-rapporter-ing, lån avstämt, sä-kerhet avstämd	BSB/SBB	Nej	SICA	
...	EES – MIC	Enparts-rapporter-ing EES, lån av-stämt, säkerhet av-stämmd	Utlåning och in-låning av värde-papper eller rå-varor	...	SIUR	
...	Ej EES – MIC	Marginalutlåning
...

⁽¹⁾ Ange de relevanta index som tas upp i fält 25 i tabell 2 "Uppgifter om lån och säkerheter" i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2019/363.