KOMMISSIONENS GENNEMFØRELSESFORORDNING (EU) 2019/363

af 13. december 2018

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

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

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]), navnlig artikel 4 stk. 10,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre ([2]), særlig artikel 9, stk. 6, og

ud fra følgende betragtninger:

(1) De nærmere oplysninger, som modparter i værdipapirfinansieringstransaktioner indberetter til transaktionsregistre eller Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (»ESMA«), bør indgives i et harmoniseret format for at lette indsamling, aggregering og sammenligning af data på tværs af transaktionsregistre. For at minimere omkostningerne for de indberettende modparter bør indberetningsformatet for værdipapirfinansieringstransaktioner i videst muligt omfang være i overensstemmelse med det format, der foreskrives for indberetning af derivataftaler i artikel 9 i forordning (EU) nr. 648/2012. Ved denne forordning foreskrives derfor formatet for hvert af de felter, som skal indberettes, og indberetninger standardiseres ved henvisning til en ISO-standard, som er almindeligt anvendt i finansverdenen.

(2) Det globale Legal Entity Identifier-system (»LEI-system«) er nu blevet gennemført fuldt ud, og hver modpart i en værdipapirfinansieringstransaktion bør derfor kun anvende dette system til at identificere en juridisk enhed i indberetninger. For at modpartens brug af LEI-systemet kan være effektiv, bør denne modpart sikre, at de referencedata, der vedrører dennes LEI-kode, fornyes i overensstemmelse med en akkrediteret LEI-udsteders betingelser (lokal driftsenhed). Der arbejdes i øjeblikket på at udvide det globale LEI-system således, at det kan identificere juridiske enheders filialer. Indtil denne udvidelse er afsluttet og anses for at være egnet med henblik på indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, og denne forordning er ændret i overensstemmelse hermed, bør ISO-koden for det land, hvor filialen er beliggende, anvendes til at identificere denne filial, hvis der indgås aftale om en værdipapirfinansieringstransaktion gennem en modparts filial.

(3) Der arbejdes også på at udvikle et globalt Unique Trader Identifier-system (»UTI-system«) til at identificere værdipapirfinansieringstransaktioner. Indtil dette globale UTI-system er udviklet og anses for at være egnet med henblik på indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, og denne forordning er ændret i overensstemmelse hermed, bør der anvendes en entydig transaktionsidentifikator, som modparterne er enige om, til at identificere en værdipapirfinansieringstransaktion.

(4) Artikel 4a i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 ([3]) indeholder en procedure til fastlæggelse af den enhed, som er ansvarlig for at generere en entydig transaktionsidentifikator med henblik på indberetning af derivataftaler i de situationer, hvor modparterne ikke er enige om, hvilken enhed der er ansvarlig for at generere den entydige transaktionsidentifikator. For at sikre overensstemmelse mellem indberetning af derivataftaler og af værdipapirfinansieringstransaktioner bør der indføres en lignende procedure for modparter, som indberetter værdipapirfinansieringstransaktioner.

([1]) EUT L 337 af 23.12.2015, s. 1.
([2]) EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1.
([3]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 af 19. december 2012 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for formatet for og hyppigheden af handelsindberetninger til transaktionsregistre i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre (EUT L 352 af 21.12.2012, s. 20).

(5) I øjeblikket finder der ikke en fælles markedspraksis for fastlæggelse af modpartssiden i en værdipapirfinansieringstransaktion. Derfor bør der indføres særlige bestemmelser med henblik på at sikre nøjagtig og konsekvent fastlæggelse af, hvem der er sikkerhedsstiller og sikkerhedshaver i en værdipapirfinansieringstransaktion.

(6) Der indgives muligvis en række indberetninger om en enkelt værdipapirfinansieringstransaktion, f.eks. hvis der foretages flere på hinanden følgende ændringer af denne værdipapirfinansieringstransaktion. For at sikre, at de enkelte indberetninger vedrørende en værdipapirfinansieringstransaktion og hver enkelt værdipapirfinansieringstransaktion som helhed forstås korrekt, bør indberetningerne indgives kronologisk i den rækkefølge, hvor de indberettede hændelser fandt sted.

(7) For at mindske den byrde, der er forbundet med indberetning af ændringer af visse værdier, navnlig nærmere oplysninger om sikkerhedsstillelsens værdi, om stillet eller modtaget margen eller om genanvendelse af sikkerhedsstillelse, bør disse nærmere oplysninger kun indberettes, som de fremstår ved hver enkelt dags slutning, hvis de adskiller sig fra de tidligere indberettede nærmere oplysninger.

(8) De nærmere oplysninger om et udestående margenlån bør indberettes, som de fremstår ved hver enkelt dags slutning, hvis der netto debiteres et beløb (net cash debit) i basisvalutaen, eller hvis en modparts korte markedsværdi er positiv.

(9) Markedsværdien af udlånte eller lånte værdipapirer bør indberettes, som den fremstår ved hver enkelt dags slutning. Når modparterne indberetter markedsværdien af sikkerhedsstillelse, bør de på lignende vis indberette værdien, som den fremstår ved hver enkelt dags slutning.

(10) Nærværende forordning er baseret på det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som ESMA har forelagt Kommissionen i overensstemmelse med proceduren i artikel 15 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed) ([4]).

(11) ESMA har afholdt åbne offentlige høringer om udkastet til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, analyseret de potentielle omkostninger og fordele samt anmodet interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold artikel 37 i forordning (EU) nr. 1095/2010, om en udtalelse.

(12) Som det er tilfældet i forbindelse med indberetning af værdipapirfinansieringstransaktioner, er visse identifikatorer og koder, som skal anvendes til indberetning af derivataftaler, fortsat ved at blive udviklet. Indtil disse identifikatorer og koder foreligger og anses for at være egnede med henblik på indberetning, og gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 er blevet ændret i overensstemmelse hermed, skal derivater, for hvilke der ikke findes en kode i henhold til ISO 6166 ISIN eller en AII-kode, i henhold til samme forordning klassificeres ved anvendelse af en kode i henhold til ISO 10692 CFI og indberetninger af derivater identificeres ved anvendelse af en entydig transaktionsidentifikator, som modparterne er enige om. Af hensyn til retssikkerheden i forbindelse med proceduren til ændring af de krav, der stilles til indberetning af derivataftaler, og den påkrævede overensstemmelse mellem indberetning af derivater og af værdipapirfinansieringstransaktioner bør gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 kun henvise til de krav, der i øjeblikket stilles til denne indberetning.

(13) Gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 bør derfor ændres —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Datastandarder og formater for indberetninger af værdipapirfinansieringstransaktioner

De nærmere oplysninger om en værdipapirfinansieringstransaktion i en indberetning, som skal indgives i henhold til artikel 4, stk. 1 i forordning (EU) 2015/2365, gives i overensstemmelse med de standarder og formater, der er præciseret i tabel 1-5 i bilag I. Denne indberetning indgives i en fælles elektronisk og maskinlæsbar form og i et fælles XML-skema udformet i overensstemmelse med ISO 20022-metoden.

([4]) EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84.

Artikel 2

Identifikation af modparter og andre enheder

1. I den indberetning, der er omhandlet i artikel 1, anvendes der en kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) til at identificere følgende:

a) en berettiget modtager, der er en juridisk person

b) en mæglerenhed

c) en central modpart (»CCP«), som er meddelt tilladelse i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012

d) et clearingmedlem

e) en låneagent

f) en deltager i en værdipapircentral (»CSD«)

g) en modpart, der er en juridisk person

h) en trepartsagent

i) en enhed, der indgiver oplysninger

j) en udsteder af et værdipapir, som har været udlånt, lånt eller stillet som sikkerhed i en værdipapirfinansieringstransaktion.

2. En modpart i en værdipapirfinansieringstransaktion sikrer, at de referencedata, der vedrører dennes kode i henhold til ISO 17442, fornyes i overensstemmelse med en af det globale LEI-systems akkrediterede lokale driftsenheders betingelser.

3. Hvis der indgås aftale om en værdipapirfinansieringstransaktion gennem en modparts filial, anvendes i den i artikel 1 omhandlede indberetning den kode, der er præciseret i felt 7 og i felt 8 i tabel 1 i bilag I til at identificere denne filial af en modpart.

Artikel 3

Entydig transaktionsidentifikator

1. En indberetning identificeres ved hjælp af en entydig transaktionsidentifikator (»UTI«), som modparterne er enige om, i overensstemmelse med det format, der er præciseret i felt 1 i tabel 2 i bilag I.

2. Hvis modparterne ikke er enige om, hvilken enhed der er ansvarlig for at generere den entydige transaktionsidentifikator, som skal knyttes til indberetningen, skal modparterne fastlægge, hvilken enhed der er ansvarlig for at generere en entydig transaktionsidentifikator, i overensstemmelse med følgende:

a) for centralt gennemførte og clearede værdipapirfinansieringstransaktioner skal den entydige transaktionsidentifikator genereres af den centrale modpart for clearingmedlemmet i forbindelse med clearing. Clearingmedlemmet skal generere en anden entydig transaktionsidentifikator for sin modpart

b) for centralt gennemførte, men ikke centralt clearede værdipapirfinansieringstransaktioner, skal den entydige transaktionsidentifikator genereres af handelsstedet for dettes medlem

c) for centralt bekræftede og clearede værdipapirfinansieringstransaktioner skal den entydige transaktionsidentifikator genereres af den centrale modpart for clearingmedlemmet i forbindelse med clearing. Clearingmedlemmet skal generere en anden entydig transaktionsidentifikator for sin modpart

d) for værdipapirfinansieringstransaktioner, der bekræftes centralt ved hjælp af elektroniske midler, men som ikke cleares centralt, skal den entydige transaktionsidentifikator genereres af den platform, hvor transaktionerne bekræftes, i forbindelse med bekræftelse

e) for alle andre værdipapirfinansieringstransaktioner end de i litra a)-d) omhandlede gælder følgende:

   i) hvis finansielle modparter indgår aftale om en værdipapirfinansieringstransaktion med ikke-finansielle modparter, skal de finansielle modparter generere den entydige transaktionsidentifikator

   ii) for alle andre ud- eller indlånstransaktioner i værdipapirer end de i nr. i) omhandlede skal sikkerhedsstilleren som omhandlet i artikel 4 generere den entydige transaktionsidentifikator

iii) for alle andre værdipapirfinansieringstransaktioner end de i nr. i) og ii) omhandlede skal sikkerhedshaveren som omhandlet i artikel 4 generere den entydige transaktionsidentifikator.

3. Den modpart, som genererer den entydige transaktionsidentifikator, skal underrette den anden modpart om den pågældende entydige transaktionsidentifikator rettidigt, således at sidstnævnte kan opfylde sin indberetningsforpligtelse.

Artikel 4

Modpartsside

1. Den i felt 9 i tabel 1 i bilag I omhandlede modpartsside til værdipapirfinansieringstransaktionen skal identificeres i overensstemmelse med stk. 2-4.

2. I forbindelse med genkøbstransaktioner, buy/sell-back-transaktioner og sell/buy-back-transaktioner skal den modpart, som køber værdipapirer, råvarer eller garanterede rettigheder vedrørende ejendomsretten til værdipapirer eller råvarer i det første ben eller spot-benet af handelen og indvilliger i at sælge dem til en nærmere angiven pris på et senere tidspunkt i det sidste ben eller forward-benet af handelen, identificeres som sikkerhedshaver i felt 9 i tabel 1 i bilag I. Den modpart, som sælger disse værdipapirer, råvarer eller garanterede rettigheder, skal identificeres som sikkerhedsstiller i felt 9 i tabel 1 i bilag I.

3. I forbindelse med indlånstransaktioner i værdipapirer eller råvarer og udlånstransaktioner i værdipapirer eller råvarer skal den modpart, som udlåner værdipapirerne eller råvarerne på den betingelse, at låntager returnerer tilsvarende værdipapirer eller råvarer på et senere tidspunkt eller efter anmodning fra overdrageren, identificeres som sikkerhedshaver i felt 9 i tabel 1 i bilag I. Den modpart, som låner disse værdipapirer eller råvarer, skal identificeres som sikkerhedsstiller i felt 9 i tabel 1 i bilag I.

4. I forbindelse med margenudlånstransaktioner skal låntageren, som er den modpart, der ydes kredit til mod sikkerhedsstillelse, identificeres som sikkerhedsstiller i felt 9 i tabel 1 i bilag I. Långiveren, som er den modpart, der yder kredit mod sikkerhedsstillelse, skal identificeres som sikkerhedshaver i felt 9 i tabel 1 i bilag I.

Artikel 5

Hyppigheden af indberetninger om værdipapirfinansieringstransaktioner

1. Alle de indberetninger af nærmere oplysninger om en værdipapirfinansieringstransaktion, der er præciseret i artikel 1, stk. 2, i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/356 ([5]), skal indgives kronologisk i den rækkefølge, hvor de indberettede hændelser fandt sted.

2. En modpart i en margenudlånstransaktion skal indberette de nærmere oplysninger om det udestående margenlån, som de fremstår ved hver enkelt dags slutning, hvis der netto debiteres et beløb (net cash debit) i basisvalutaen, eller hvis en modparts korte markedsværdi er positiv.

3. En modpart i en udestående værdipapirfinansieringstransaktion skal foretage en indberetning af enhver ændring af de nærmere oplysninger vedrørende dataene om sikkerhedsstillelse i felt 75-94 i tabel 2 i bilag I af handlingstypen »Collateral update« (ajourføring af sikkerhedsstillelse). Modparten skal foretage en indberetning af disse ændrede nærmere oplysninger, som de fremstår ved hver enkelt dags slutning, indtil modparten foretager en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktionens afvikling, eller modparten foretager en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktionen af handlingstypen »Error« (fejl), eller indtil værdipapirfinansieringstransaktionen udløber, alt efter hvad der indtræffer først.

4. En modpart i en udestående værdipapirfinansieringstransaktion skal foretage en indberetning af enhver ændring af markedsværdien af de udlånte eller lånte værdipapirfinansieringstransaktioner ved dagens slutning i felt 57 i tabel 2 i bilag I af handlingstypen »Valuation update« (værdiajourføring). Modparten skal indberette denne ændrede markedsværdi, som den fremstår ved hver enkelt dags slutning, indtil modparten foretager en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktionens afvikling, eller modparten foretager en indberetning af værdipapirfinansieringstransaktionen af handlingstypen »Error« (fejl), eller indtil værdipapirfinansieringstransaktionen udløber.

([5]) 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 (se side 1 i denne EUT)

5. En modpart skal foretage en indberetning af enhver ændring af den samlede stillede eller modtagne margen for alle clearede værdipapirfinansieringstransaktioner, som den fremstår ved dagens slutning, i felt 8-19 i tabel 3 i bilag I, af handlingstypen »Margin update« (ajourføring af margen), når modparten tidligere har foretaget en indberetning af den samlede stillede eller modtagne margen af handlingstypen »New« (ny).

6. En modpart skal foretage en indberetning af enhver ændring af værdien af genanvendt sikkerhedsstillelse, geninvesterede kontantbeløb og finansieringskilderne, som den fremstår ved dagens slutning, i felt 8-14 i tabel 4 i bilag I, af handlingstypen »Reuse update« (ajourføring af genanvendelse), når modparten har foretaget en indberetning af de relevante værdier af handlingstypen »New« (ny).

Artikel 6

Ændringer af gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012

I gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 foretages følgende ændringer:

1) I artikel 4 foretages følgende ændringer:

   a) Stk. 7 affattes således:

      »Derivatet skal klassificeres i felt 4 i bilagets tabel 2 ved anvendelse af en kode i henhold til ISO 10692 Classification of Financial Instruments (CFI).«

   b) Stk. 8 og 9 udgår.

2) Artikel 4a, stk. 1, affattes således:

   »1. Indberetninger skal identificeres ved hjælp af en global entydig transaktionsidentifikator, som modparterne er enige om.«

3) Bilaget affattes som angivet i bilag II til denne forordning.

Artikel 7

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 I

Formater, der skal anvendes til indberetning af de nærmere oplysninger om værdipapirfinansieringstransaktioner, jf. artikel 4, stk. 1 og 5, i forordning (EU) 2015/2365

Tabel 1

Modpartsdata

Nr.	Felt	Format
1	Tidsstempel for indberetningen	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), dvs. ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
2	Indberettende enhed	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
3	Indberettende modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
4	Type indberettende modpart	»F« — Finansiel modpart »N« — Ikke-finansiel modpart
5	Den indberettende modparts sektor	Taksonomi for finansielle modparter: »CDTI« — Kreditinstitut, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU ([1]) eller Rådets forordning (EU) nr. 1024/2013 ([2]), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »INVF« — Investeringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU ([3]), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »INUN« — Forsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF ([4]) (Solvens II), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »AIFD« — AIF forvaltet af AIFM'er, der er meddelt tilladelse eller registreret i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU ([5]), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »ORPI« — Arbejdsmarkedsrelateret pensionskasse, der er meddelt tilladelse eller registreret i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2003/41/EF ([6]), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »CCPS« — Central modpart, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 ([7]), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »REIN« — Genforsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Solvens II, eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »CSDS« — Værdipapircentral, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 909/2014 ([8]), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt »UCIT« — UCITS (investeringsinstitutter) og dets administrationsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF ([9]), eller en tredjelandsenhed, for hvilken der ville kræves meddelelse af tilladelse eller registrering i henhold til nævnte retsakt

Nr.	Felt	Format
		Taksonomi for ikke-finansielle modparter: Nedenstående kategorier svarer til hovedafdelingerne i den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter i Det Europæiske Fællesskab (NACE) som defineret i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1893/2006 ([10]) »A« — Landbrug, jagt, skovbrug og fiskeri »B« — Råstofindvinding »C« — Fremstillingsvirksomhed »D« — El-, gas- og fjernvarmeforsyning »E« — Vandforsyning; kloakvæsen, affaldshåndtering og rensning af jord og grundvand »F« — Bygge- og anlægsvirksomhed »G« — Engroshandel og detailhandel; reparation af motorkøretøjer og motorcykler »H« — Transport og godshåndtering »I« — Overnatningsfaciliteter og restaurationsvirksomhed »J« — Information og kommunikation »K« — Pengeinstitut- og finansvirksomhed, forsikring »L« — Fast ejendom »M« — Liberale, videnskabelige og tekniske tjenesteydelser »N« — Administrative tjenesteydelser og hjælpetjenester »O« — Offentlig forvaltning og forsvar; socialsikring »P« — Undervisning »Q« — Sundhedsvæsen og sociale foranstaltninger »R« — Kultur, forlystelser og sport »S« — Andre serviceydelser »T« — Private husholdninger med ansat medhjælp; husholdningers produktion af varer og tjenesteydelser til eget brug »U« — Ekstraterritoriale organisationer og organer
6	Yderligere sektorklassificering	»ETFT« — ETF »MMFT« — MMF »REIT« — REIT »OTHR« — Andet
7	Filial af den indberettende modpart	ISO 3166-1 alpha-2-landekode (bogstavkode bestående af 2 tegn).
8	Filial af den anden modpart	ISO 3166-1 alpha-2-landekode (bogstavkode bestående af 2 tegn).
9	Modpartsside	»TAKE« — Sikkerhedshaver »GIVE« — Sikkerhedsstiller
10	Enhed med ansvar for indberetningen	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
11	Anden modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode). Kundekode (op til 50 alfanumeriske tegn).
12	Den anden modparts land	ISO 3166-1 alpha-2-landekode (bogstavkode bestående af 2 tegn).

Nr.	Felt	Format
13	Berettiget modtager	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode). Kundekode (op til 50 alfanumeriske tegn).
14	Trepartsagent	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
15	Mægler	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
16	Clearingmedlem	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
17	Deltager i en værdipapircentral (»CSD«) eller indirekte deltager	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
18	Låneagent	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).

([1]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU af 26. juni 2013 om adgang til at udøve virksomhed som kreditinstitut og om tilsyn med kreditinstitutter og investeringsselskaber (EUT L 176 af 27.6.2013, s. 338).
([2]) Rådets forordning (EU) nr. 1024/2013 af 15. oktober 2013 om overdragelse af specifikke opgaver til Den Europæiske Centralbank i forbindelse med politikker vedrørende tilsyn med kreditinstitutter (EUT L 287 af 29.10.2013, s. 63).
([3]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter (EUT L 173 af 12.6.2014, s. 349).
([4]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (Solvens II) (EUT L 335 af 17.12.2009, s. 1).
([5]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU af 8. juni 2011 om forvaltere af alternative investeringsfonde (EUT L 174 af 1.7.2011, s. 1).
([6]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2003/41/EF af 3. juni 2003 om arbejdsmarkedsrelaterede pensionskassers aktiviteter og tilsynet hermed (EUT L 235 af 23.9.2003, s. 10).
([7]) 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).
([8]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 909/2014 af 23. juli 2014 om forbedring af værdipapirafviklingen i Den Europæiske Union og om værdipapircentraler (EUT L 257 af 28.8.2014, s. 1).
([9]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF af 13. juli 2009 om samordning af love og administrative bestemmelser om visse institutter for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitutter) (EUT L 302 af 17.11.2009, s. 32).
([10]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1893/2006 af 20. december 2006 om oprettelse af den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter NACE rev. 2 (EUT L 393 af 30.12.2006, s. 1).

Tabel 2

Data om lån og sikkerhedsstillelse

Nr.	Felt	Format
1	Entydig transaktionsidentifikator (UTI)	Kode med op til 52 alfanumeriske tegn, herunder fire specialtegn: Kun de store bogstaver fra A til og med Z og tallene fra 0 til og med 9 er tilladt.
2	Indberetningens referencenummer	Kode med op til 52 alfanumeriske tegn, herunder fire specialtegn: Kun de store bogstaver fra A til og med Z og tallene fra 0 til og med 9 er tilladt.
3	Dato for hændelsen	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
4	Type værdipapirfinansieringstransaktion	»SLEB«- udlån i værdipapirer eller råvarer eller indlån i værdipapirer eller råvarer »SBSC« — buy/sell-back-transaktion eller sell/buy-back-transaktion »REPO« — genkøbstransaktion »MGLD« — margenudlånstransaktion

Nr.	Felt	Format
5	Clearet	»true« (rigtigt) »false« (forkert)
6	Tidsstempel for clearing	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), dvs. ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
7	Central modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
8	Handelsplads	Kode i henhold til ISO 10383 Market Identifier Code (MIC) (4 alfanumeriske tegn). Hvis der findes segmenterede MIC'er for en handelsplads, skal den segmenterede MIC anvendes.
9	Type masteraftale	»MRAA« — MRA »GMRA« — GMRA »MSLA« — MSLA »GMSL« — GMSLA »ISDA« — ISDA »DERP« — Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierpensionsgeschäfte »CNBR« — China Bond Repurchase Master Agreement »KRRA« — Korea Financial Investment Association (KOFIA) Standard Repurchase Agreement »CARA« — Investment Industry Regulatory Organization of Canada (IIROC) Repurchase/Reverse Repurchase Transaction Agreement »FRFB« — Convention-Cadre Relative aux Operations de Pensions Livrees »CHRA« -Swiss Master Repurchase Agreement »DEMA« — German Master Agreement »JPBR« — Japanese Master Agreement on the Transaction with Repurchase Agreement of the Bonds »ESRA« — Contrato Marco de compraventa y Reporto de valores »OSLA« — Overseas Securities Lending Agreement (OSLA) »MEFI« — Master Equity and Fixed Interest Stock Lending Agreement (MEFISLA) »GESL« — Gilt Edged Stock Lending Agreement (GESLA) »KRSL« — Korean Securities Lending Agreement (KOSLA) »DERD« — Deutscher Rahmenvertrag für Wertpapierdarlehen »AUSL« — Australian Masters Securities Lending Agreement (AMSLA) »JPBL« — Japanese Master Agreement on Lending Transaction of Bonds »JPSL« — Japanese Master Agreement on the Borrowing and Lending Transactions of Share Certificates »BIAG« — bilateral agreement »CSDA« — CSD bilateral agreement Eller »OTHR«, hvis masteraftaletypen ikke er medtaget på ovenstående liste
10	Andre typer masteraftaler	Op til 50 alfanumeriske tegn.
11	Masteraftale version	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)
12	Tidsstempel for gennemførelse	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), dvs. ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
13	Valørdato (Startdato)	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)

Nr.	Felt	Format
14	Udløbsdato (Slutdato)	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
15	Afviklingsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
16	Minimumsfrist for opsigelse	Heltalsfelt på op til 3 tegn.
17	Første mulige dato for call-back	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
18	Indikator for generel sikkerhedsstillelse	»SPEC« — specifik sikkerhedsstillelse »GENE« — generel sikkerhedsstillelse
19	DBV-indikator (DBV = Delivery By Value)	»true« (rigtigt) »false« (forkert)
20	Metode anvendt til at stille sikkerhed	»TTCA«- aftale om sikkerhedsstillelse i form af overdragelse af ejendomsret »SICA«- aftale om sikkerhedsstillelse i form af pantsætning »SIUR«- aftale om sikkerhedsstillelse i form af pantsætning med brugsret
21	Uden fastsat løbetid	»true« (rigtigt) »false« (forkert)
22	Afviklingsmulighed	»EGRN« (evergreen) — ubegrænset »ETSB« (extendable) — kan forlænges »NOAP« — ikke relevant

I forbindelse med margenudlån skal de attributter, der er opregnet i felt 23-34, gentages og suppleres for hver enkelt valuta i margenlånet.

23	Fast rente	Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
24	Konvention for beregning af dage	Koden, der svarer til konventionen for beregning af dage: »A001« — IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule »A002« — IC30365 »A003« — IC30Actual »A004« — Actual360 »A005« — Actual365Fixed »A006« — ActualActualICMA »A007« — IC30E360orEuroBondBasismodel1 »A008« — ActualActualISDA »A009« — Actual365LorActuActubasisRule »A010« — ActualActualAFB »A011« — IC30360ICMAor30360basicrule »A012« — IC30E2360orEurobondbasismodel2 »A013« — IC30E3360orEurobondbasismodel3 »A014« — Actual365NL Eller op til 35 alfanumeriske tegn, hvis konventionen for beregning af dage ikke er medtaget i ovenstående liste.

Nr.	Felt	Format
25	Variabel rente	Koden, der svarer til indekset for den variable sats »EONA« — EONIA »EONS« — EONIA SWAP »EURI« — EURIBOR »EUUS« — EURODOLLAR »EUCH« — EuroSwiss »GCFR« — GCF REPO »ISDA« — ISDAFIX »LIBI« — LIBID »LIBO« — LIBOR »MAAA« — Muni AAA »PFAN« — Pfandbriefe (pantebreve) »TIBO« — TIBOR »STBO« — STIBOR »BBSW« — BBSW »JIBA« — JIBAR »BUBO« — BUBOR »CDOR« — CDOR »CIBO« — CIBOR »MOSP« — MOSPRIM »NIBO« — NIBOR »PRBO« — PRIBOR »TLBO« — TELBOR »WIBO« — WIBOR »TREA« — Treasury (statspapirer) »SWAP« — SWAP »FUSW« — Future SWAP Eller op til 25 alfanumeriske tegn, hvis referencesatsen ikke er medtaget i ovenstående liste.
26	Referenceperiode for variabel rente — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden; følgende forkortelser anvendes: »YEAR« — År »MNTH« — Måned »WEEK« — Uge »DAYS« — Dag
27	Referenceperiode for variabel rente — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rente. Op til 3 numeriske tegn.
28	Betalingshyppighed for variabel rabat — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: »YEAR« — År »MNTH« — Måned »WEEK« — Uge »DAYS« — Dag
29	Betalingshyppighed for variabel rente — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn.

Nr.	Felt	Format
30	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rente — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable reporente; følgende forkortelser anvendes: »YEAR« — År »MNTH« — Måned »WEEK« — Uge »DAYS« — Dag
31	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rente — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable reporente. Op til 3 numeriske tegn.
32	Spænd	Op til 5 numeriske tegn.
33	Margenlåns valutabeløb	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
34	Margenlåns valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
Felt 35-36 skal gentages og suppleres for hver justering af den variable rente.		
35	Justeret rente	Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
36	Rentedato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
37	Nominelt beløb på valørdato	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
38	Nominelt beløb på udløbsdato	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
39	Nominelt beløbs valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
40	Aktivtype	»SECU« — Værdipapirer »COMM« — Råvarer
41	Identifikator for værdipapir	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode).
42	Værdipapirsklassifikation	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn).
Hvis en råvare blev udlånt eller lånt, skal klassificeringen af nævnte råvare angives i felt 43, 44 og 45.		
43	Basisprodukt	Kun værdier i kolonnen »Basisprodukt« i klassificeringstabellen for råvarederivater må anvendes.

Nr.	Felt	Format
44	Underprodukt	Kun værdier i kolonnen »Underprodukt« i klassificeringstabellen for råvarederivater må anvendes.
45	Yderligere underprodukt	Kun værdier i kolonnen »Yderligere underprodukt« i klassificeringstabellen for råvarederivater må anvendes.
46	Kvantitet eller nominelt beløb	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
47	Måleenhed	»KILO« — Kilogram, »PIEC« — Piece, »TONS« — Ton, »METR« — Metre, »INCH« — Inch, »YARD« — Yard, »GBGA« — GBGallon, »GRAM« — Gram, »CMET« — Centimetre, »SMET« — SquareMetre, »FOOT« — Foot, »MILE« — Mile, »SQIN« — SquareInch, »SQFO« — SquareFoot, »SQMI« — SquareMile, »GBOU« — GBOunce, »USOU« — USOunce, »GBPI« — GBPint, »USPI« — USPint, »GBQA« — GBQuart, »USQA« — USQuart, »USGA« — USGallon, »MMET« — Millimetre, »KMET« — Kilometre, »SQYA« — SquareYard, »ACRE« — Acre, »ARES« — Are, »SMIL« — SquareMillimetre, »SCMT« — SquareCentimetre, »HECT« — Hectare, »SQKI« — SquareKilometre, »MILI« — MilliLitre, »CELI« — Centilitre, »LITR« — Litre, »PUND« — Pound, »ALOW« — Allowances, »ACCY« — AmountOfCurrency, »BARL« — Barrels, »BCUF« — BillionCubicFeet, »BDFT« — BoardFeet, »BUSL« — Bushels, »CEER« — CertifiedEmissionsReduction, »CLRT« — ClimateReserveTonnes, »CBME« — CubicMeters, »DAYS« — Days, »DMET« — DryMetricTons, »ENVC« — EnvironmentalCredit, »ENVO« — EnvironmentalOffset, »HUWG« — Hundredweight, »KWDC« — KilowattDayCapacity, »KWHO« — KilowattHours, »KWHC« — KilowattHoursCapacity, »KMOC« — KilowattMinuteCapacity, »KWMC« — KilowattMonthCapacity, »KWYC« — KilowattYearCapacity, »MWDC« — MegawattDayCapacity, »MWHO« — MegawattHours, »MWHC« — MegawattHoursCapacity, »MWMC« — MegawattMinuteCapacity, »MMOC« — MegawattMonthCapacity, »MWYC« — MegawattYearCapacity, »TONE« — MetricTons, »MIBA« — MillionBarrels, »MBTU« — OneMillionBTU, »OZTR« — TroyOunces, »UCWT« — USHundredweight, »IPNT« — IndexPoint, »PWRD« — PrincipalWithRelationToDebtInstrument, »DGEU« — DieselGallonEquivalent, »GGEU« — GasolineGallonEquivalent, »TOCD« — TonsOfCarbonDioxide.
48	Nominelt beløbs valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
49	Værdipapirkurs eller råvarepris	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler, hvis prisen angives i enheder. Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, hvis prisen angives som procentsats eller afkast. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
50	Prisvaluta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).

Nr.	Felt	Format
51	Værdipapirets kvalitet	»INVG« — Investment grade »NIVG« — Ikke-investment grade »NOTR« — Ikke-rated »NOAP« — Ikke relevant
52	Værdipapirets løbetid	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
53	Udstederens jurisdiktion	ISO 3166-1 alpha-2-landekode (bogstavkode bestående af 2 tegn).
54	Udstederens LEI-kode	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
55	Værdipapirtype	»GOVS« — Statsobligationer »SUNS« — Overstatslige obligationer og værdipapirer udstedt af agenturer »FIDE« — Gældsinstrumenter (herunder dækkede obligationer) udstedt af banker og andre finansielle institutioner »NFID« — Erhvervsobligationer (herunder dækkede obligationer) udstedt af ikke-finansielle institutioner »SEPR« — Securitiserede produkter (herunder CDO, CMBS, ABCP) »MEQU« — Aktier mv. i hovedindekser (herunder konvertible obligationer) »OEQU« — Andre aktier mv. (herunder konvertible obligationer) »OTHR« — Andre aktiver (herunder andele i gensidige fonde)
56	Lånebeløb	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
57	Markedsværdi	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
58	Fast rabat	Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.
59	Variabel rabat	Koden, der svarer til indekset for den variable sats »EONA« — EONIA »EONS« — EONIA SWAP »EURI« — EURIBOR »EUUS« — EURODOLLAR »EUCH« — EuroSwiss »GCFR« — GCF REPO »ISDA« — ISDAFIX »LIBI« — LIBID »LIBO« — LIBOR »MAAA« — Muni AAA »PFAN« — Pfandbriefe (pantebreve) »TIBO« — TIBOR »STBO« — STIBOR »BBSW« — BBSW

Nr.	Felt	Format
		»JIBA« — JIBAR »BUBO« — BUBOR »CDOR« — CDOR »CIBO« — CIBOR »MOSP« — MOSPRIM »NIBO« — NIBOR »PRBO« — PRIBOR »TLBO« — TELBOR »WIBO« — WIBOR »TREA« — Treasury (statspapirer) »SWAP« — SWAP »FUSW« — Future SWAP Eller op til 25 alfanumeriske tegn, hvis referencesatsen ikke er medtaget i ovenstående liste
60	Referenceperiode for variabel rabat — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden; følgende forkortelser anvendes: »YEAR« — År »MNTH« — Måned »WEEK« — Uge »DAYS« — Dag
61	Referenceperiode for variabel rabat — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rabat. Op til 3 numeriske tegn.
62	Betalingshyppighed for variabel rabat — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: »YEAR« — År »MNTH« — Måned »WEEK« — Uge »DAYS« — Dag
63	Betalingshyppighed for variabel rabat — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn.
64	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rabat — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rabat; følgende forkortelser anvendes: »YEAR« — År »MNTH« — Måned »WEEK« — Uge »DAYS« — Dag
65	Hyppighed for genfastsættelse af variabel rabat — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rabat. Op til 3 numeriske tegn.
66	Rabatspænd	Op til 5 numeriske tegn.
67	Vederlag	Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«.

Nr.	Felt	Format
68	Eksklusivaftaler	»true« (rigtigt) »false« (forkert)
69	Udestående margenlån	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
70	Udestående margenlåns basisvaluta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
71	Markedsværdi på kort sigt	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
Data om sikkerhedsstillelse		
72	SL-signalisering af udlån i værdipapirer uden sikkerhedsstillelse	»true« (rigtigt) »false« (forkert)
73	Sikkerhedsstillelse for nettoeksponering	»true« (rigtigt) »false« (forkert)
74	Sikkerhedsstillelsens valørdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
Hvis der blev anvendt specifik sikkerhedsstillelse, skal felt 75-94 gentages og suppleres for hver enkelt sikkerhedsstillelseskomponent, hvis det er relevant.		
75	Type sikkerhedsstillelseskomponent	»SECU« — Værdipapirer »COMM« — Råvarer (kun for repoer, ud- og indlån i værdipapirer og råvarer og buy/sell-backs) »CASH« — Kontanter
Hvis kontanter er blevet stillet som sikkerhed, skal dette angives i felt 76 og 77.		
76	Kontant sikkerhedsstillelsesbeløb	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
77	Kontant sikkerhedsstillelses valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
78	Identifikation af et værdipapir stillet som sikkerhed	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode).
79	Klassifikation af et værdipapir stillet som sikkerhed	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn).

Nr.	Felt	Format
Hvis en råvare er blevet stillet som sikkerhed, skal klassificeringen af nævnte råvare angives i felt 80, 81 og 82.		
80	Basisprodukt	Kun værdier i kolonnen »Basisprodukt« i klassificeringstabellen for råvarederivater må anvendes.
81	Underprodukt	Kun værdier i kolonnen »Underprodukt« i klassificeringstabellen for råvarederivater må anvendes.
82	Yderligere underprodukt	Kun værdier i kolonnen »Yderligere underprodukt« i klassificeringstabellen for råvarederivater må anvendes.
83	Sikkerhedsstillelsens kvantitet eller nominelle beløb	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
84	Måleenhed for sikkerhedsstillelse	»KILO« — Kilogram, »PIEC« — Piece, »TONS« — Ton, »METR« — Metre, »INCH« — Inch, »YARD« — Yard, »GBGA« — GBGallon, »GRAM« — Gram, »CMET« — Centimetre, »SMET« — SquareMetre, »FOOT« — Foot, »MILE« — Mile, »SQIN« — SquareInch, »SQFO« — SquareFoot, »SQMI« — SquareMile, »GBOU« — GBOunce, »USOU« — USOunce, »GBPI« — GBPint, »USPI« — USPint, »GBQA« — GBQuart, »USQA« — USQuart, »USGA« — USGallon, »MMET« — Millimetre, »KMET« — Kilometre, »SQYA« — SquareYard, »ACRE« — Acre, »ARES« — Are, »SMIL« — SquareMillimetre, »SCMT« — SquareCentimetre, »HECT« — Hectare, »SQKI« — SquareKilometre, »MILI« — MilliLitre, »CELI« — Centilitre, »LITR« — Litre, »PUND« — Pound, »ALOW« — Allowances, »ACCY« — AmountOfCurrency, »BARL« — Barrels, »BCUF« — BillionCubicFeet, »BDFT« — BoardFeet, »BUSL« — Bushels, »CEER« — CertifiedEmissionsReduction, »CLRT« — ClimateReserveTonnes, »CBME« — CubicMeters, »DAYS« — Days, »DMET« — DryMetricTons, »ENVC« — EnvironmentalCredit, »ENVO« — EnvironmentalOffset, »HUWG« — Hundredweight, »KWDC« — KilowattDayCapacity, »KWHO« — KilowattHours, »KWHC« — KilowattHoursCapacity, »KMOC« — KilowattMinuteCapacity, »KWMC« — KilowattMonthCapacity, »KWYC« — KilowattYearCapacity, »MWDC« — MegawattDayCapacity, »MWHO« — MegawattHours, »MWHC« — MegawattHoursCapacity, »MWMC« — MegawattMinuteCapacity, »MMOC« — MegawattMonthCapacity, »MWYC« — MegawattYearCapacity, »TONE« — MetricTons, »MIBA« — MillionBarrels, »MBTU« — OneMillionBTU, »OZTR« — TroyOunces, »UCWT« — USHundredweight, »IPNT« — IndexPoint, »PWRD« — PrincipalWithRelationToDebtInstrument, »DGEU« — DieselGallonEquivalent, »GGEU« — GasolineGallonEquivalent, »TOCD« — TonsOfCarbonDioxide.
85	Sikkerhedsstillelsens nominelle beløbs valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
86	Prisvaluta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
87	Pris pr. enhed	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler, hvis prisen angives i enheder. Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, hvis prisen angives som procentsats eller afkast. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.

Nr.	Felt	Format
88	Sikkerhedsstillelsens markedsværdi	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
89	Haircut eller margen	Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
90	Sikkerhedsstillelsens kvalitet	»INVG« — Investment grade »NIVG« — Ikke-investment grade »NOTR« — Ikke-rated »NOAP« — Ikke relevant
91	Værdipapirets udløbsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
92	Udstederens jurisdiktion	ISO 3166-1 alpha-2-landekode (bogstavkode bestående af 2 tegn).
93	Udstederens LEI-kode	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
94	Type sikkerhedsstillelse	»GOVS« — Statsobligationer »SUNS« — Overstatslige obligationer og værdipapirer udstedt af agenturer »FIDE« — Gældsinstrumenter (herunder dækkede obligationer) udstedt af banker og andre finansielle institutioner »NFID« — Erhvervsobligationer (herunder dækkede obligationer) udstedt af ikke-finansielle institutioner »SEPR« — Securitiserede produkter (herunder CDO, CMBS, ABCP) »MEQU« — Aktier mv. i hovedindekser (herunder konvertible obligationer) »OEQU« — Andre aktier mv. (herunder konvertible obligationer) »OTHR«- Andre aktiver (herunder andele i gensidige fonde)
95	Mulighed for genanvendelse af sikkerhedsstillelse	»true« (rigtigt) »false« (forkert)
Hvis der er blevet anvendt en sikkerhedsstillelseskurv, angives dette i felt 96. Den nærmere fordeling af sikkerhedsstillelse for værdipapirfinansieringstransaktioner mod en sikkerhedspulje angives i felt 75-94, hvis oplysningerne foreligger.		
96	Identifikator for sikkerhedsstillelseskurv	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode) eller »NTAV«
97	Porteføljekode	Kode med 52 alfanumeriske tegn, herunder fire specialtegn: .- _. Specialtegn må ikke anvendes i begyndelsen og slutningen af koden. Der må ikke anvendes mellemrum.
98	Handlingstype	»NEWT« — Ny »MODI« - Ændring »VALU« — Værdiansættelse »COLU« — Ajourføring af sikkerhedsstillelse »EROR« — Fejl »CORR« - Ændring

Nr.	Felt	Format
		»ETRM« — Afvikling/Tidlig afvikling »POSC« — Positionskomponent
99	Niveau	»TCTN« — Transaktion »PSTN« — Position

Tabel 3

Data om margen

Nr.	Felt	Format
1	Tidsstempel for indberetningen	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), dvs. ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
2	Dato for hændelsen	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
3	Indberettende enhed	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
4	Indberettende modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
5	Enhed med ansvar for indberetningen	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
6	Anden modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
7	Porteføljekode	Kode med 52 alfanumeriske tegn, herunder fire specialtegn: -_. Specialtegn må ikke anvendes i begyndelsen og slutningen af koden. Der må ikke anvendes mellemrum.
8	Stillet initialmargen	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
9	Valuta for den stillede initialmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
10	Stillet variationsmargen	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
11	Valuta for den posterede variationsmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
12	Modtaget initialmargen	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
13	Valuta for den modtagne initialmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
14	Modtaget variationsmargen	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.

Nr.	Felt	Format
15	Valuta for den modtagne variationsmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
16	Overskydende stillet sikkerhed	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
17	Valuta for den overskydende stillede sikkerhed	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
18	Overskydende modtaget sikkerhed	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
19	Valuta for den overskydende modtagne sikkerhed	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
20	Handlingstype	»NEWT« — Ny »MARU« — Ajourføring af margen »EROR« — Fejl »CORR« — Ændring

Tabel 4

Data om genanvendelse, geninvestering af kontantbeløb og finansieringskilder

Nr.	Felt	Format
1	Tidsstempel for indberetningen	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), dvs. ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
2	Dato for hændelsen	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
3	Indberettende enhed	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
4	Indberettende modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
5	Enhed med ansvar for indberetningen	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
Felt 6 skal gentages og suppleres for hver enkelt sikkerhedsstillelseskomponent.		
6	Type sikkerhedsstillelseskomponent	»SECU« — Værdipapirer »CASH« — Kontanter
Felt 7, 8, 9 og 10 skal gentages og suppleres for hvert enkelt værdipapir.		
7	Sikkerhedsstillelseskomponent	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode).
8	Sikkerhedsstillelsens genanvendelsesværdi	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
9	Anslået genanvendelse af sikkerhedsstillelse	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.

Nr.	Felt	Format
10	Genanvendt sikkerhedsstillelses valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
11	Geninvesteringssats	Op til 11 numeriske tegn, inkl. op til 10 decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«.
Felt 12, 13 og 14 skal gentages og suppleres for hver enkelt investering, hvis kontant sikkerhedsstillelse er blevet geninvesteret, og for hver enkelt valuta.		
12	Type geninvesteret kontantbeløb	»MMFT« — registeret pengemarkedsfond »OCMP« — enhver anden blandet pulje »REPM« — repomarkedet »SDPU« — direkte køb af værdipapirer »OTHR« — andet
13	Geninvesteret kontantbeløb	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
14	Geninvesteret kontantbeløbs valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
I forbindelse med margenudlånstransaktioner skal modparten gentage og supplere felt 15, 16 og 17 for hver enkelt finansieringskilde og skal angive oplysningerne i disse felter på enhedsniveau.		
15	Finansieringskilder	»REPO« — repoer eller BSB »SECL« — kontant sikkerhedsstillelse fra udlån i værdipapirer »FREE« — gratis kreditter »CSHS« — provenu fra short selling (kunde) »BSHS« — provenu fra short selling (mægler) »UBOR« — lån uden sikkerhedsstillelse »OTHR« — andet
16	Finansieringskildernes markedsværdi	Op til 18 numeriske tegn, inkl. op til 5 decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Hvis dette ikke er muligt, pro rata-beløb.
17	Finansieringskildernes valuta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn).
18	Handlingstype	»NEWT« — Ny »REUU« — Ajourføring af genanvendelse »EROR« — Fejl »CORR« — Ændring

Tabel 5

Klassificering af råvarer

Basisprodukt	Underprodukt	Yderligere underprodukt
»AGRI« — Landbrugsrelateret	»GROS« — Korn, olieholdige frø	»FWHT« — Foderhvede »SOYB« — Sojabønner »CORN« — Majs »RPSD« — Raps »RICE« — Ris »OTHR« — Andet

Basisprodukt	Underprodukt	Yderligere underprodukt
	»SOFT« — Landbrugsprodukter (»softs«)	»CCOA« — Kakao »ROBU« — Robustakaffe »WHSG« — Hvidt sukker »BRWN« — Råsukker »OTHR« — Andet
	»POTA« — Kartofler	
	»OOLI« — Olivenolie	»LAMP« — Lampante (olivenolie, som ikke anvendes til konsum) »OTHR« — Andet
	»DIRY« — Mejeriprodukter	
	»FRST« — Skovbrugsprodukter	
	»SEAF« — Fisk og skaldyr	
	»LSTK« — Husdyr	
	»GRIN« — Korn	»MWHT« — Brødhvede »OTHR« — Andet
	»OTHR« — Andet	
»NRGY« — Energi	»ELEC« — Elektricitet	»BSLD« — Basisbelastning »FITR« — Finansielle transmissionsrettigheder »PKLD« — Spidsbelastning »OFFP« — Uden for spidsbelastning »OTHR« — Andet
	»NGAS« — Naturgas	»GASP« — GASPOOL »LNGG« — LNG »NBPG« — NBP »NCGG« — NCG »TTFG« — TTF »OTHR« — Andet
	»OILP« — Olie	»BAKK« — Bakken-skiferolie »BDSL« — Biodiesel »BRNT« — Brent »BRNX« — Brent NX »CNDA« — Canadisk »COND« — Kondensat »DSEL« — Diesel »DUBA« — Dubai »ESPO« — ESPO »ETHA« — Ethanol »FUEL« — Brændstoffer »FOIL« — Brændselsolie »GOIL« — Gasolie

Basisprodukt	Underprodukt	Yderligere underprodukt
		»GSLN« — Benzin »HEAT« — Fyringsolie »JTFL« — Jetbrændstof »KERO« — Petroleum »LLSO« — Light Louisiana Sweet (LLS) »MARS« — Mars »NAPH« — Nafta »NGLO« — NGL »TAPI« — Tapis »URAL« — Uralbjergene »WTIO« — WTI (West Texas Intermediate) »OTHR« — Andet
	»COAL«- Kul »INRG« — Inter Energy »RNNG« — Vedvarende energi »LGHT« — Lette produkter »DIST« — Distillater »OTHR« — Andet	
»ENVR« — Miljørelateret	»EMIS« — Emissioner	»CERE« — CER »ERUE« — ERU »EUAE« — EUA »EUAA« — EUAA »OTHR« — Andet
	»WTHR« — Vejr »CRBR« — Kulstofrelateret »OTHR« — Andet	
»FRGT« — Fragt	»WETF« — Flydende gods	»TNKR« — Tankskibe »OTHR« — Andet
	»DRYF« — Tørt gods	»DBCR« — Bulkcarriers til tørlast »OTHR« — Andet
	»CSHP« — Containerskibe	
	»OTHR« — Andet	
»FRTL« — Gødningsstoffer	»AMMO« — Ammoniak »DAPH« — Diammoniumphosphat (DAP) »PTSH« — Kaliumgødning »SLPH« — Svovl »UREA« — Urinstof »UAAN« — UAN (urinstof og ammoniumnitrat) »OTHR« — Andet	

Basisprodukt	Underprodukt	Yderligere underprodukt
»INDP« — Industrielle produkter	»CSTR« — Byggeri »MFTG« — Fremstilling	
»METL« — Metaller	»NPRM« — Ikke-ædle metaller	»ALUM« — Aluminium »ALUA« — Aluminiumlegeringer »CBLT« — Kobolt »COPR« — Kobber »IRON« — Jernmalm »LEAD« — Bly »MOLY« — Molybdæn »NASC« — NASAAC »NICK« — Nikkel »STEL« — Stål »TINN« — Tin »ZINC« — Zink »OTHR« — Andet
	»PRME« — Ædle metaller	»GOLD« — Guld »SLVR« — Sølv »PTNM« — Platin »PLDM« — Palladium »OTHR« — Andet
»MCEX« — Eksotiske derivater vedrørende flere råvarer (»Multi Commodity Exotic«)		
»PAPR« — Papir	»CBRD« — Containerboard »NSPT« — Avispapir »PULP« — Papirmasse »RCVP« — Returpapir »OTHR« — Andet	
»POLY« — Polypropylen	»PLST« — Plast »OTHR« — Andet	
»INFL«- Inflation		
»OEST« — Officielle økonomiske statistikker		
»OTHC« — Andre C10 som defineret i tabel 10.1 i afsnit 10 i bilag III til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2017/583 [1]		
»OTHR« — Andet		

[1] Kommissionens delegerede forordning (EU) 2017/583 af 14. juli 2016 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 600/2014 om markeder for finansielle instrumenter for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for gennemsigtighedsmetoden for markedspladser og investeringsselskaber med hensyn til obligationer, strukturerede finansielle produkter, demissionskvoter og derivater (EUT L 87 af 31.3.2017, s. 229).

BILAG II

Bilaget til gennemførelsesforordning (EU) nr. 1247/2012 affattes således:

»*BILAG*

Tabel 1

Modpartsdata

	Felt	Format
	Aftalens parter	
1	Tidsstempel for indberetningen	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC), ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ
2	ID for den indberettende modpart	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
3	ID-type for den anden modpart	»LEI« for kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) »CLC« for kundekode
4	Den anden modparts ID	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode). Kundekode (op til 50 alfanumeriske tegn).
5	Den anden modparts land	Landekode i henhold til ISO 3166 (2 bogstaver)
6	Den indberettende modparts branche	Taksonomi for finansielle modparter: A = livsforsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF ([1]) C = kreditinstitut, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU ([2]) F = investeringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2004/39/EF ([3]) I = skadesforsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2009/138/EF L = alternativ investeringsfond forvaltet af forvaltere af alternative investeringsfonde (FAIF'er), der er meddelt tilladelse eller registreret i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU ([4]) O = arbejdsmarkedsrelateret pensionskasse som defineret i artikel 6, litra a), i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2003/41/EF ([5]) R = genforsikringsselskab, der er meddelt tilladelse i henhold til direktiv 2009/138/EF U = institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) og dets administrationsselskab, godkendt i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF ([6]) Taksonomi for ikke-finansielle modparter: Følgende kategorier svarer til hovedafdelingerne i den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter i Det Europæiske Fællesskab (NACE) som defineret i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1893/2006 ([7]) 1 = Landbrug, jagt, skovbrug og fiskeri 2 = Råstofindvinding 3 = Fremstillingsvirksomhed 4 = El-, gas- og fjernvarmeforsyning

	Felt	Format
		5 = Vandforsyning, kloakvæsen, affaldshåndtering og rensning af jord og grundvand 6 = Byggeri og anlægsvirksomhed 7 = Engroshandel og detailhandel; reparation af motorkøretøjer og motorcykler 8 = Transport og godshåndtering 9 = Overnatningsfaciliteter og restaurationsvirksomhed 10 = Information og kommunikation 11 = Pengeinstitut- og finansvirksomhed, forsikring 12 = Fast ejendom 13 = Liberale, videnskabelige og tekniske tjenesteydelser 14 = Administrative tjenesteydelser og hjælpetjenester 15 = Offentlig forvaltning og forsvar; socialsikring 16 = Undervisning 17 = Sundhedsvæsen og sociale foranstaltninger 18 = Kultur, forlystelser og sport 19 = Andre serviceydelser 20 = Private husholdninger med ansat medhjælp; husholdningers produktion af varer og tjenesteydelser til eget brug 21 = Ekstraterritoriale organisationer og organer Hvis der indberettes mere end en enkelt aktivitet, angives koderne efter de tilsvarende aktiviteters relative betydning med en bindestreg (»-«) imellem. Udfyldes ikke i tilfælde af CCP'er og andre typer modparter, jf. artikel 1, stk. 5, i forordning (EU) nr. 648/2012.
7	Type indberettende modpart	F = Finansiel modpart N = Ikke-finansiel modpart C = Central modpart O = Andet
8	Mægler-ID	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode).
9	ID for indberettende enhed	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode)
10	ID for clearingmedlem	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode)
11	ID-type for berettiget modtager	»LEI« for kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) »CLC« for kundekode
12	ID for berettiget modtager	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn, eller kundekode på op til 50 alfanumeriske tegn i tilfælde, hvor kunden ikke er berettiget til en LEI-kode
13	Handler i egenskab af	P = Ordregiver A = Agent
14	Modpartsside	B = Køber S = Sælger Udfyldes i overensstemmelse med artikel 3a

	Felt	Format
15	Direkte tilknyttet forretningsmæssige aktiviteter eller likviditetsfinansiering	Y = ja N = nej
16	Clearinggrænseværdi	Y = Over tærsklen N = Under tærsklen
17	Aftalens værdi	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.
18	Valuta for værdien	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)
19	Tidsstempel for værdiansættelse	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC) (ÅÅÅÅ-MM-DDTt:mm:ssZ)
20	Værdiansættelsestype	M = Efter mark-to-market-princippet O = Mark-to-model-princippet C = CCP'ers værdiansættelse.
21	Sikkerhedsstillelse	U = ingen sikkerhedsstillelse PC = delvis sikkerhedsstillelse OC = envejssikkerhedsstillelse FC = fuld sikkerhedsstillelse Udfyldes i overensstemmelse med artikel 3b
22	Sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Y = ja N = nej
23	Kode for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Op til 52 alfanumeriske tegn, herunder fire specialtegn: ». - _.« Specialtegn må ikke anvendes i begyndelsen og slutningen af koden. Der må ikke anvendes mellemrum.
24	Stillet initialmargen	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
25	Valuta for den stillede initialmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)
26	Stillet variationsmargen	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
27	Valuta for den stillede variationsmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)
28	Modtaget initialmargen	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
29	Valuta for den modtagne initialmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)

	Felt	Format
30	Modtaget variationsmargen	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
31	Valuta for den modtagne variationsmargen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)
32	Overskydende stillet sikkerhed	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
33	Valuta for den overskydende stillede sikkerhed	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)
34	Overskydende modtaget sikkerhed	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.
35	Valuta for den overskydende modtagne sikkerhed	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)

(1) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (Solvens II) (EUT L 335 af 17.12.2009, s. 1).
(2) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU af 26. juni 2013 om adgang til at udøve virksomhed som kreditinstitut og om tilsyn med kreditinstitutter og investeringsselskaber, om ændring af direktiv 2002/87/EF og om ophævelse af direktiv 2006/48/EF og 2006/49/EF (EUT L 176 af 27.6.2013, s. 338).
(3) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2004/39/EF af 21. april 2004 om markeder for finansielle instrumenter, om ændring af Rådets direktiv 85/611/EØF, og 93/6/EØF samt Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2000/12/EF og om ophævelse af Rådets direktiv 93/22/EØF (EUT L 145 af 30.4.2004, s. 1).
(4) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU af 8. juni 2011 om forvaltere af alternative investeringsfonde og om ændring af direktiv 2003/41/EF og 2009/65/EF samt forordning (EF) nr. 1060/2009 og (EU) nr. 1095/2010 (EUT L 174 af 1.7.2011, s. 1).
(5) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2003/41/EF af 3. juni 2003 om arbejdsmarkedsrelaterede pensionskassers aktiviteter og tilsynet hermed (EUT L 235 af 23.9.2003, s. 10).
(6) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF af 13. juli 2009 om samordning af love og administrative bestemmelser om visse institutter for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitutter) (EUT L 302 af 17.11.2009, s. 32).
(7) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1893/2006 af 20. december 2006 om oprettelse af den statistiske nomenklatur for økonomiske aktiviteter NACE rev. 2 og om ændring af Rådets forordning (EØF) nr. 3037/90 og visse EF-forordninger om bestemte statistiske områder (EUT L 393 af 30.12.2006, s. 1).

Tabel 2

Fælles data

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
	Afdeling 2a — aftaletype		Alle aftaler
1	Aftaletype	CD = Finansielle differencekontrakter FR = Fremtidige renteaftaler (forward rate agreements) FU = Futures FW = Forwards OP = Option SB = Spreadbet SW = Swap ST = Swaption OT = Andet	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
2	Aktivklasse	CO = Råvarer og demissionskvoter CR = Lån CU = Valuta EQ = Aktier IR = Rentesats	
	Afdeling 2b — Aftaledata		Alle aftaler
3	Type produktklassifikation	C = CFI	
4	Produktklassifikation	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn)	
5	Type produktidentifikation	Angiv den relevante identifikation: I = ISIN A = AII	
6	Produktidentifikation	For produktidentifikator type I: ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode) For produktidentifikator type A: Fuldstændig AII-kode	
7	Type identifikation af det underliggende aktiv	I = ISIN A = AII B = Kurv X = Indeks	
8	Identifikation af det underliggende aktiv	Til identifikation af det underliggende, type I: ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode) Til identifikation af underliggende aktiv type A: fuldstændig AII-kode Til identifikation af underliggende aktiv type B: identifikation af alle de enkelte komponenter ved hjælp af kode i henhold til ISO 6166 ISIN eller fuldstændig AII-kode. Identifikatorer for de enkelte komponenter adskilles med en tankestreg »-«. Til identifikation af det underliggende, type X: kode i henhold til ISO 6166 ISIN, hvis en sådan foreligger, og ellers indeksets fulde navn som tildelt af indeksproducenten	
9	Notionel valuta 1	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)	
10	Notionel valuta 2	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)	
11	Leveringsvaluta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)	
	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen		Alle aftaler
12	Transaktions-ID	Kode med op til 52 alfanumeriske tegn, herunder fire specialtegn:». - _.« Specialtegn må ikke anvendes i begyndelsen og slutningen af koden. Der må ikke anvendes mellemrum.	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
13	Indberetningens referencenummer	Et alfanumerisk felt på op til 52 tegn	
14	Kompleks transaktions-komponent-ID	Et alfanumerisk felt på op til 35 tegn	
15	Handelssted	Kode i henhold til ISO 10383 Market Identifier Code (MIC), 4 alfanumeriske tegn, i overensstemmelse med artikel 4b.	
16	Komprimering	Y = aftalen skyldes komprimering N = aftalen skyldes ikke komprimering	
17	Pris/kurs	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn. Hvis prisen indberettes i procentværdier, angives den som en procent, hvor 100 % angives som »100«	
18	Prisnotering	U = Enheder P = Procent Y = Afkast	
19	Valuta for prisen	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)	
20	Notionel værdi	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	
21	Prismultiplikator	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.	
22	Mængde	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.	
23	Forudbetaling	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Negativt fortegn anvendes til at angive, at betalingen er foretaget, men ikke modtaget. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
24	Leveringstype	C = Kontant P = Fysisk O = Valgfrit for modparten, eller hvis det afgøres af tredjepart	
25	Tidsstempel for gennemførelse	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC) (ÅÅÅÅ-MM-DDTtt:mm:ssZ)	
26	Ikrafttrædelsesdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
27	Forfaldsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
28	Udløbsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
29	Afviklingsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
30	Masteraftaletype	Fritekst, felt op til 50 tegn, angivelse af navnet på masteraftalen, hvis en sådan anvendes	
31	Masteraftaleversion	ISO 8601-datoformat (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
	Afdeling 2d — Risikoreduktion/indberetning		Alle aftaler
32	Tidsstempel for bekræftelse	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC) (ÅÅÅÅ-MM-DDTtt:mm:ssZ)	
33	Bekræftelsesmiddel	Y = Ikke-elektronisk bekræftelse N = Ingen bekræftelse E = Elektronisk bekræftelse	
	Afdeling 2e — Clearing		Alle aftaler
34	Clearingforpligtelse	Y = ja N = nej	
35	Clearet	Y = ja N = nej	
36	Tidsstempel for clearing	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC) (ÅÅÅÅ-MM-DDTtt:mm:ssZ)	
37	CCP	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20-tegns alfanumerisk kode	
38	Koncernintern	Y = ja N = nej	
	Afdeling 2f — Rentesatser		Rentederivater
39	Fast rente for første ben	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«.	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
		Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	
40	Fast rente for andet ben	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som procent, hvor 100 % angives som »100«. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	
41	Rentedagskonvention for den faste rente for første ben	Nævner/tæller, hvis både nævner og tæller er numeriske tegn, eller udtrykket »Actual«, f.eks. 30/360 eller Actual/365	
42	Rentedagskonvention for den faste rente for andet ben	Nævner/tæller, hvis både nævner og tæller er numeriske tegn, eller udtrykket »Actual«, f.eks. 30/360 eller Actual/365	
43	Betalingshyppighed for den faste rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
44	Betalingshyppighed for den faste rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn.	
45	Betalingshyppighed for den faste rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
46	Betalingshyppighed for den faste rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn.	
47	Betalingshyppighed for den variable rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
48	Betalingshyppighed for den variable rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn.	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
49	Betalingshyppighed for den variable rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
50	Betalingshyppighed for den variable rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne udveksler betalinger. Op til 3 numeriske tegn.	
51	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
52	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente. Op til 3 numeriske tegn.	
53	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
54	Hyppighed for genfastsættelse af den variable rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver, hvor ofte modparterne genfastsætter den variable rente. Op til 3 numeriske tegn.	
55	Variabel rente for første ben	Navnet på indekset for den variable rente »EONA« — EONIA »EONS« — EONIA SWAP »EURI« — EURIBOR »EUUS« — EURODOLLAR »EUCH« — EuroSwiss »GCFR« — GCF REPO »ISDA« — ISDAFIX »LIBI« — LIBID »LIBO« — LIBOR »MAAA« — Muni AAA »PFAN« — Pfandbriefe (pantebreve) »TIBO« — TIBOR »STBO« — STIBOR »BBSW« — BBSW	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
		»JIBA« — JIBAR »BUBO« — BUBOR »CDOR« — CDOR »CIBO« — CIBOR »MOSP« — MOSPRIM »NIBO« — NIBOR »PRBO« — PRIBOR »TLBO« — TELBOR »WIBO« — WIBOR »TREA« — Treasury (statspapirer) »SWAP« — SWAP »FUSW« — Future SWAP Eller op til 25 alfanumeriske tegn, hvis referencesatsen ikke er medtaget i ovenstående liste	
56	Referenceperiode for den variable rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
57	Referenceperiode for den variable rente for første ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver referenceperioden. Op til 3 numeriske tegn.	
58	Variabel rente for andet ben	Navnet på indekset for den variable rente »EONA« — EONIA »EONS« — EONIA SWAP »EURI« — EURIBOR »EUUS« — EURODOLLAR »EUCH« — EuroSwiss »GCFR« — GCF REPO »ISDA« — ISDAFIX »LIBI« — LIBID »LIBO« — LIBOR »MAAA« — Muni AAA »PFAN« — Pfandbriefe (pantebreve) »TIBO« — TIBOR »STBO« — STIBOR »BBSW« — BBSW »JIBA« — JIBAR »BUBO« — BUBOR »CDOR« — CDOR »CIBO« — CIBOR »MOSP« — MOSPRIM »NIBO« — NIBOR »PRBO« — PRIBOR	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
		»TLBO« — TELBOR »WIBO« — WIBOR »TREA« — Treasury (statspapirer) »SWAP« — SWAP »FUSW« — Future SWAP Eller op til 25 alfanumeriske tegn, hvis referencesatsen ikke er medtaget i ovenstående liste	
59	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden; følgende forkortelser anvendes: Y = År M = Måned W = Uge D = Dag	
60	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — multiplikator	Hel multiplikator af den tidsperiode, der beskriver referenceperioden. Op til 3 numeriske tegn.	
	Afdeling 2g — Udenlandsk valuta		Valutaderivater
61	Leveringsvaluta 2	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)	
62	Valutakurs 1	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	
63	Terminskurs	Op til 10 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	
64	Valutakursgrundlag	To ISO 4217-valutakoder adskilt med skråstreg (»/«). Den første valutakode angiver basisvalutaen og den anden noteringsvalutaen.	
	Afdeling 2h — Råvarer og demissionskvoter		Råvare- og emissionskvotederivater
	Generelt		
65	Overordnet råvarekategori	AG = Landbrug EN = Energi	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
		FR = Fragt ME = Metaller IN = Indeks EV = Miljø EX = Eksotisk OT = Andet	
66	Varebeskrivelse	*Landbrug* GO = Korn, olieholdige frø DA = Mejeriprodukter LI = Levende dyr FO = Skovbrugsprodukter SO = Softs SF = Fisk og skaldyr OT = Andet *Energi* OI = Olie NG = Naturgas CO = Kul EL = El IE = Flere energiformer OT = Andet *Fragt* DR = Tør WT = Våd OT = Andet *Metaller* PR = Ædelmetaller NP = Ikke-ædelmetaller *Miljømæssig* WE = Vejr EM = Emissioner OT = Andet	
	Energi		
67	Leveringssted eller -område	EIC-kode, 16 alfanumeriske tegn Gentages.	
68	Forbindelsespunkt	EIC-kode, 16 alfanumeriske tegn	
69	Belastningstype	BL = Basisbelastning PL = Spidsbelastning OP = Uden for spidsbelastning BH = Time/Tidsblokke SH = Formet (Shaped) GD = Gasdøgn OT = Andet	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
	Gentages for felt 70-77		
70	Leveringsintervaller	tt:mmZ	
71	Dato og klokkeslæt for leveringsstart	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC) (ÅÅÅÅ-MM-DDTtt:mm:ssZ)	
72	Dato og klokkeslæt for leveringsstop	Datoformat i henhold til ISO 8601 og klokkeslætsformat i henhold til Coordinated Universal Time (UTC) (ÅÅÅÅ-MM-DDTtt:mm:ssZ)	
73	Varighed	N = Minutter H = Time D = Dag W = Uge M = Måned Q = Kvartal S = Sæson Y = Årlig O = Andet	
74	Ugedage	WD = Hverdage WN = Weekend MO = Mandag TU = Tirsdag WE = Onsdag TH = Torsdag FR = Fredag SA = Lørdag SU = Søndag Det er tilladt at angive flere værdier adskilt med skråstreg (»/«)	
75	Leveringskapacitet	Op til 20 numeriske tegn, herunder decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	
76	Antal enheder	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d	

	Felt	Format	Berørte typer derivataftaler
		Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Pris pr. mængde pr. tidsinterval	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn.	
	Afdeling 2i — Optioner		Aftaler, hvori indgår en option
78	Optionsform	P = Put C = Call O = hvis det ikke kan fastslås, om der er tale om en call- eller put-option	
79	Optionens udnyttelsesmåde	A = amerikansk B = Bermuda- E = europæisk S = asiatisk Der kan angives mere end en enkelt værdi	
80	Strikepris (renteloft/minimumsrentesats)	Op til 20 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum. Et eventuelt minustegn tæller ikke som et numerisk tegn. Hvis strikeprisen indberettes i procentværdier, angives den som en procent, hvor 100 % angives som »100«	
81	Strikeprisnotering	U = Enheder P = Procent Y = Afkast	
82	Udløbsdato for det underliggende aktiv	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)	
	Afdeling 2j — Kreditderivater		
83	Rang	SNDB = Prioriteret gæld, f.eks. Senior Unsecured Debt (Corporate/Financial), Foreign Currency Sovereign Debt (Government)	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
		SBOD = Efterstillet gæld, f.eks. Subordinated or Lower Tier 2 Debt (Banks), Junior Subordinated eller Upper Tier 2 Debt (Banks) OTHR = Andet, f.eks. præferenceaktier eller kernekapital (Banks) eller andre kreditderivater	
84	Referenceenhed	Landekode i henhold til ISO 3166 (2 bogstaver) eller Landekode i henhold til ISO 3166-2, 2 bogstaver, efterfulgt af en tankestreg (»-«) og en subnational enhedskode på op til 3 alfanumeriske tegn eller Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI) (20-tegns alfanumerisk kode)	
85	Betalingshyppighed	MNTH = Månedlig QURT = Kvartalsvis MIAN = Halvårlig YEAR = Årlig	
86	Beregningsgrundlag	Nævner/tæller, hvis både nævner og tæller er numeriske tegn, eller udtrykket »Actual«, f.eks. 30/360 eller Actual/365	
87	Serie	Heltalsfelt på op til 5 tegn	
88	Version	Heltalsfelt på op til 5 tegn	
89	Indeksfaktor	Op til 10 numeriske tegn, inkl. decimaler. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.	
90	Tranche	T = Opdelt i trancher U = Ikke-opdelt i trancher	
91	Attachment point	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som en decimalbrøk mellem 0 og 1. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.	
92	Detachment point	Op til 10 numeriske tegn, herunder decimaler, udtrykt som en decimalbrøk mellem 0 og 1. Decimaltegnet tæller ikke som et numerisk tegn. Angives i givet fald med et punktum.	
	Afdeling 2k — Ændringer af aftalen		
93	Type handling	N = Ny M = Ændring	

	Felt	Format	Berørte typer derivat-aftaler
		E = Fejl C = Førtidig ophævelse R = Korrektion Z = Komprimering V = Værdiajourføring P = Positionskomponent	
94	Niveau	T = Transaktion P = Position«	