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

(Text av betydelse för EES)

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

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 artikel 4.10,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 av den 4 juli 2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister ([2]), särskilt artikel 9.6, och

av följande skäl:

(1) De detaljer som motparter i transaktioner för värdepappersfinansiering ska rapportera till transaktionsregister eller till Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten (Esma) bör lämnas in i ett harmoniserat format för att underlätta insamling, aggregering och jämförande av uppgifter mellan olika transaktionsregister. För att minimera rapporterande motparters kostnader bör rapporteringsformatet för transaktioner för värdepappersfinansiering i möjligaste mån vara i linje med det format som föreskrivs för rapportering av derivatkontrakt enligt artikel 9 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012. Den här förordningen fastställer därför formatet för vart och ett av de fält som ska rapporteras, och standardiserar en rapport med hänvisning till en ISO-standard som används allmänt i finansbranschen.

(2) Det globala systemet med identifieringskoder för juridiska personer (LEI) har nu genomförts fullt ut, och varje motpart i en transaktion för värdepappersfinansiering bör därför enbart använda detta system för att identifiera en juridisk person i en rapport. För att en motparts användning av LEI-systemet ska bli effektivt bör motparten säkerställa att de referensuppgifter som hör till dess LEI-kod förnyas i enlighet med en ackrediterad LEI-utfärdares (lokal driftsenhet) villkor. Det globala LEI-systemet håller för närvarande på att byggas ut för att möjliggöra identifiering av filialer till juridiska personer. Till dess att utbyggnaden är slutförd och har bedömts lämplig för rapportering av transaktioner för värdepappersfinansiering, och till dess denna förordning har ändrats i enlighet därmed, bör ISO-koden för det land där filialen är belägen användas för att identifiera denna filial om en transaktion för värdepappersfinansiering har genomförts via en filial till en motpart.

(3) Ett globalt system för unika transaktionskoder (UTI) håller också på att utvecklas. Till dess att detta globala UTI-system är färdigställt och har bedömts lämpligt för rapportering av transaktioner för värdepappersfinansiering, och till dess att denna förordning ändrats i enlighet därmed, bör motparterna komma överens om en UTI-kod som ska användas för att identifiera en transaktion för värdepappersfinansiering.

(4) I artikel 4a i kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 ([3]) föreskrivs ett förfarande för att fastställa vilken enhet som ansvarar för att ta fram en UTI-kod i fråga om rapportering av derivatkontrakt i situationer där motparter inte kan komma överens om vilken enhet som ska ta fram UTI-koden. För att säkerställa att rapportering av derivatkontrakt och rapportering av transaktioner för värdepappersfinansiering ligger i linje med varandra bör ett liknande förfarande inrättas för motparter som rapporterar transaktioner för värdepappersfinansiering.

([1]) EUT L 337, 23.12.2015, s. 1.
([2]) EUT L 201, 27.7.2012, s. 1.
([3]) Kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 av den 19 december 2012 om fastställande av tekniska genomförandestandarder för form och frekvens för rapportering om handel till transaktionsregister enligt Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister (EUT L 352, 21.12.2012, s. 20).

(5) Det finns för närvarande ingen allmän marknadspraxis för att fastställa motpartssidan i en transaktion för värdepappersfinansiering. Därför bör särskilda regler inrättas för att säkerställa en korrekt och konsekvent identifiering av säkerhetsställaren och säkerhetstagaren i en transaktion för värdepappersfinansiering.

(6) Ett antal rapporter kan lämnas in för en enskild transaktion för värdepappersfinansiering, exempelvis om successiva ändringar görs i transaktionen. För att säkerställa begripligheten i varje rapport som gäller en transaktion för värdepappersfinansiering och begripligheten i varje transaktion för värdepappersfinansiering som helhet, bör rapporterna lämnas in i kronologisk ordning efter tidpunkt då de rapporterade händelserna inträffade.

(7) För att minska den rapporteringsbörda som följer av rapportering av ändringar av vissa värden – i synnerhet uppgifter om säkerheters värde, om marginalsäkerheter som ställts eller mottagits och om återanvändning av säkerheter – bör dessa uppgifter endast rapporteras på grundval av ställning i slutet av varje dag om de skiljer sig från tidigare rapporterade uppgifter.

(8) Uppgifterna om ett utestående marginallån bör rapporteras enligt deras ställning i slutet av varje dag vid debetsaldo för kontanter i basvalutan eller om marknadsvärdet på motpartens korta positioner är positivt.

(9) Marknadsvärdet av utlånade eller lånade värdepapper bör rapporteras enligt ställningen i slutet av varje dag. På liknande sätt bör motparter, när de rapporterar marknadsvärdet av säkerheter, göra detta enligt ställningen i slutet av varje dag.

(10) Denna förordning grundas på det förslag till tekniska genomförandestandarder som Esma överlämnat till kommissionen enligt förfarandet i artikel 15 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten) ([4]).

(11) Esma har också genomfört öppna offentliga samråd om utkasten till tekniska genomförandestandarder, 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.

(12) I likhet med rapporteringen av transaktioner för värdepappersfinansiering är vissa identifierare och koder som ska användas för rapportering av derivatkontrakt fortfarande under utveckling. Till dess att dessa identifierare och koder finns tillgängliga, har bedömts lämpliga för rapportering och genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 har ändrats i enlighet därmed, föreskriver den förordningen användning av en CFI-kod enligt ISO 10692 för att klassificera derivat för vilka en ISIN-kod enligt ISO 6166 eller en AII-kod inte är tillgängliga samt användning av en sådan unik transaktionskod som motparterna kommit överens om för att identifiera en derivatrapport. För att säkerställa rättslig förutsebarhet i fråga om vilket förfarande som är lämpligt för att ändra de krav som gäller rapportering av derivatkontrakt, och att rapportering av derivat och av transaktioner för värdepappersfinansiering ligger tillräckligt i linje med varandra, bör genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 endast hänvisa till de krav som för närvarande är tillämpliga på sådan rapportering.

(13) Genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 bör därför ändras i enlighet med detta.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Standarder och format för uppgifter i rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering

De detaljer om transaktioner för värdepappersfinansiering som ska rapporteras enligt artikel 4.1 i förordning (EU) 2015/2365 ska lämnas i enlighet med de standarder och format som anges i tabell 1–5 i bilaga I. Rapporten ska lämnas i ett vanligt elektroniskt och maskinläsbart format och i en vanlig XML-mall i enlighet med metoden enligt ISO 20022.

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

Artikel 2

Identifiering av motparter och andra enheter

1. Den rapport som avses i artikel 1 ska använda en identifieringskod för juridiska personer enligt ISO 17442 (nedan kallad *LEI-kod*) för att identifiera följande:

a) En betalningsmottagare som är juridisk person.

b) En mäklare.

c) En central motpart som auktoriserats i enlighet med förordning (EU) nr 648/2012.

d) En clearingmedlem.

e) Ett ombud för en långivare.

f) En deltagare i en värdepapperscentral.

g) En motpart som är juridisk person.

h) En trepartsagent.

i) En rapporterande enhet.

j) En emittent av ett värdepapper som lånats ut, lånats eller ställts som säkerhet i en transaktion för värdepappersfinansiering.

2. En motpart i en transaktion för värdepappersfinansiering ska säkerställa att de referensuppgifter som hör till dess LEI-kod enligt ISO 17442 förnyas i enlighet med villkoren hos någon av de lokala driftsenheterna i det globala LEI-systemet.

3. Om en transaktion för värdepappersfinansiering ingås genom en filial till en motpart ska den rapport som avses i artikel 1 använda den kod som anges i fälten 7 och 8 i tabell 1 i bilaga I för att identifiera denna filial till en motpart.

Artikel 3

Unik transaktionskod

1. En rapport ska identifieras genom en unik transaktionskod (nedan kallad *UTI-kod*) som motparterna kommer överens om i enlighet med det format som fastställs i fält 1 i tabell 2 i bilaga I.

2. Om motparterna inte kan komma överens om vilken enhet som ansvarar för att ta fram UTI-koden för rapporten, ska de fastställa detta ansvar i enlighet med följande:

a) För transaktioner för värdepappersfinansiering som utförs och clearas centralt ska UTI-koden tas fram vid clearingen av den centrala motparten för clearingmedlemmens räkning. En annan UTI-kod ska tas fram av clearingmedlemmen för dennes motpart.

b) För transaktioner som genomförs centralt men inte clearas centralt ska den unika transaktionskoden tas fram av handelsplatsen för dess medlems räkning.

c) För transaktioner för värdepappersfinansiering som bekräftas och clearas centralt ska UTI-koden tas fram av en central motpart för clearingmedlemmen vid tidpunkten för clearing. En annan UTI-kod ska tas fram av clearingmedlemmen för dennes motpart.

d) För transaktioner för värdepappersfinansiering som har bekräftats centralt på elektronisk väg men inte clearats centralt ska UTI-koden genereras genom plattformen för transaktionsbekräftelse vid bekräftelsen.

e) För alla andra transaktioner för värdepappersfinansiering än de som avses i led a–d gäller följande:

   i) Om finansiella motparter ingår en transaktion för värdepappersfinansiering med icke-finansiella motparter är det den finansiella motparten som ska ta fram UTI-koden.

   ii) För alla utlånings- eller lånetransaktioner för värdepapper utom de som avses i led i ska säkerhetsställaren, som avses i artikel 4, ta fram UTI-koden.

iii) För alla transaktioner för värdepappersfinansiering utom de som avses i leden i och ii ska säkerhetstagaren, som avses i artikel 4, ta fram UTI-koden.

3. Den motpart som tar fram UTI-koden ska meddela koden till den andra motparten i tid så att denne kan fullgöra sin rapporteringsskyldighet.

Artikel 4

Motpartssida

1. Den motpartssida i en transaktion för värdepappersfinansiering som avses i fält 9 i tabell 1 i bilagan ska identifieras i enlighet med punkterna 2–4.

2. När det gäller återköpstransaktioner, köp- och återförsäljningstransaktioner och sälj- och återköpstransaktioner ska den motpart som köper värdepapper, råvaror eller garanterade rättigheter avseende äganderätt till värdepapper eller råvaror i transaktionens öppnings- eller spotdel och som går med på att sälja dem till ett visst pris vid en framtida tidpunkt i transaktionens stängnings- eller terminsdel identifieras som säkerhetstagare i fält 9 i tabell 1 i bilaga I. Den motpart som säljer dessa värdepapper, råvaror eller garanterade rättigheter ska identifieras som säkerhetsställare i fält 9 i tabell 1 i bilaga I.

3. När det gäller utlåningstransaktioner och lånetransaktioner för värdepapper och råvaror ska den motpart som lånar ut värdepapperen eller råvarorna på villkor att låntagaren ska lämna tillbaka dessa vid en framtida tidpunkt eller på överlåtarens begäran, identifieras som säkerhetstagare i fält 9 i tabell 1 i bilaga I. Den motpart som lånar dessa värdepapper eller råvaror ska identifieras som säkerhetsställare i fält 9 i tabell 1 i bilaga I.

4. När det gäller marginalutlåning ska låntagaren, dvs. den motpart som erhåller kredit i utbyte mot säkerhet, identifieras som säkerhetsställare i fält 9 i tabell 1 i bilaga I. Långivaren, dvs. den motpart som tillhandahåller krediten i utbyte mot säkerhet, ska identifieras som säkerhetstagare i fält 9 i tabell 1 i bilaga I.

Artikel 5

Frekvens för rapporter om transaktioner för värdepappersfinansiering

1. Alla rapporter avseende uppgifter om en transaktion för värdepappersfinansiering enligt artikel 1.2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/356 ([5]) ska lämnas i kronologisk ordning efter tidpunkt då de rapporterade händelserna inträffade.

2. En motpart i en marginalutlåningstransaktion ska rapportera detaljerna för det utestående marginallånet enligt ställningen i slutet av varje dag vid debetsaldo för kontanter i basvalutan eller om marknadsvärdet på motpartens korta positioner är positivt.

3. En motpart i en utestående transaktion för värdepappersfinansiering ska rapportera eventuella ändringar av detaljer som avser uppgifter om säkerheter i fälten 75–94 i tabell 2 i bilaga I med åtgärdstyp ”Uppdatering av säkerhet”. Motparten ska rapportera dessa ändrade detaljer enligt ställningen i slutet av varje dag till dess den rapporterar att transaktionen för värdepappersfinansiering har avslutats, eller till dess transaktionen för värdepappersfinansiering löper ut, beroende på vilken av dessa händelser som infaller först.

4. En motpart i en utestående transaktion för värdepappersfinansiering ska rapportera eventuella ändringar av marknadsvärdet vid dagens slut (*end-of-day market value*) för värdepapper som lånats ut eller lånats i fält 57 i tabell 2 i bilaga I med åtgärdstyp ”Värderingsuppdatering”. Motparten ska rapportera det ändrade marknadsvärdet enligt ställningen i slutet av varje dag till dess den rapporterar att transaktionen för värdepappersfinansiering har avslutats, eller till dess transaktionen för värdepappersfinansiering löper ut.

([5]) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/356 av den 13 december 2018 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 vad gäller tekniska tillsynsstandarder som specificerar de uppgifter om transaktioner för värdepappersfinansiering som ska rapporteras till transaktionsregister (se sidan 1 i detta nummer av EUT).

5. En motpart ska rapportera eventuella ändringar av totalbeloppet av den marginalsäkerhet som har ställts eller mottagits för en clearad transaktion för värdepappersfinansiering enligt ställningen vid dagens slut i fälten 8–19 i tabell 3 i bilaga I med åtgärdstyp ”Uppdatering av marginalsäkerhet” efter det att den först har rapporterat totalbeloppet av marginalsäkerhet som ställts eller mottagits med åtgärdstyp ”Ny”.

6. En motpart ska rapportera eventuella ändringar av värdet av återanvända säkerheter, återinvesterade kontanter och finansieringskällan med åtgärdstyp ”Uppdatering av återanvändning” enligt dess ställning i slutet av dagen i fälten 8–14 i tabell 4 i bilaga I efter det att den rapporterat relevanta värden med åtgärdstyp ”Ny”.

Artikel 6

Ändring av genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012

Genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 ska ändras på följande sätt:

1. Artikel 4 ska ändras på följande sätt:

   a) Punkt 7 ska ersättas med följande:

      ”Derivatet ska klassificeras i fält 4 i tabell 2 i bilagan med användning av ISO 10692 för klassificering av finansiella instrument (CFI-kod).”

   b) Punkterna 8 och 9 ska utgå.

2. I artikel 4a ska punkt 1 ersättas med följande:

   ”1. Rapporter ska identifieras genom en unik transaktionskod som motparterna kommer överens om.”

3. Bilagan ska ersättas med bilaga II till denna förordning.

Artikel 7

Ikraftträdande

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

Denna förordning 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

Format som ska användas för rapporter om detaljer om transaktioner för värdepappersfinansiering, som avses i artikel 4.1 och 4.5 i förordning (EU) 2015/2365

Tabell 1

Motpartsuppgifter

Nr	Fält	Format
1	Rapporteringstillfälle	Datumformat enligt ISO 8601/UTC-tid (koordinerad universell tid), format ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Rapporterande enhet	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
3	Rapporterande motpart	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
4	Rapporterande motparts typ	”F” – finansiell motpart ”N” – icke-finansiell motpart
5	Rapporterande motparts bransch/sektor.	Taxonomi för finansiella motparter: ”CDTI” – Kreditinstitut auktoriserat i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU ([1]) eller rådets förordning (EU) nr 1024/2013 ([2]) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”INVF” – Värdepappersföretag auktoriserat i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU ([3]) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”INUN” – försäkringsföretag auktoriserat i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/138/EG ([4]) (Solvens II) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”AIFD” – AIF-fond förvaltad av AIF-förvaltare som är auktoriserade eller registrerade i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2011/61/EU ([5]) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”ORPI” – Tjänstepensionsinstitut auktoriserat eller registrerat i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/41/EG ([6]) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”CCPS” – Central motpart auktoriserad i enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 ([7]) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”REIN” – Återförsäkringsföretag auktoriserat i enlighet med Solvens II eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”CSDS” – Värdepapperscentral auktoriserad i enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 909/2014 ([8]) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten. ”UCIT” – Fondföretag och dess förvaltningsföretag auktoriserade i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/65/EU ([9]) eller en enhet i ett tredjeland för vilken auktorisation eller registrering skulle krävas i enlighet med den lagstiftningsakten.

Nr	Fält	Format
		Taxonomi för icke-finansiella motparter: Följande kategorier motsvarar huvudavdelningarna i statistisk näringsgrensindelning i Europeiska gemenskapen (Nace) enligt Europaparlamentets och rådets förordning (EG) nr 1893/2006 ([10]) ”A” – Jordbruk, skogsbruk och fiske ”B” – Utvinning av mineral ”C” – Tillverkning ”D” – Försörjning av el, gas, värme och kyla ”E” – Vattenförsörjning, avloppsrening, avfallshantering och sanering ”F” – Byggverksamhet ”G” – Handel; reparation av motorfordon och motorcyklar ”H” – Transport och magasinering ”I” – Hotell- och restaurangverksamhet ”J” – Informations- och kommunikationsverksamhet ”K” – Finans- och försäkringsverksamhet ”L” – Fastighetsverksamhet ”M” – Verksamhet inom juridik, ekonomi, vetenskap och teknik ”N” – Uthyrning, fastighetsservice, resetjänster och andra stödtjänster ”O” – Offentlig förvaltning och försvar; obligatorisk socialförsäkring ”P” – Utbildning ”Q” – Vård och omsorg; sociala tjänster ”R” – Kultur, nöje och fritid ”S” – Annan serviceverksamhet ”T” – Förvärvsarbete i hushåll; hushållens produktion av diverse varor och tjänster för eget bruk ”U” – Verksamhet vid internationella organisationer, utländska ambassader o.d.
6	Ytterligare sektorklassificering	”ETFT” – Börshandlad fond ”MMFT” – Penningmarknadsfond ”REIT” – Stiftelse för investeringar i fast egendom (REIT) ”OTHR” – Övrigt
7	Filial till den rapporterande motparten.	ISO 3166-1 alfa-2 landskod 2 alfabetiska tecken.
8	Filial till den andra motparten	ISO 3166-1 alfa-2 landskod 2 alfabetiska tecken.
9	Motpartssida	”TAKE” – Säkerhetstagare ”GIVE” – Säkerhetsställare
10	Rapporterande enhet	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
11	Den andra motparten	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken Kundkod (upp till 50 alfanumeriska tecken).
12	Den andra motpartens land	ISO 3166-1 alfa-2 landskod 2 alfabetiska tecken.

Nr	Fält	Format
13	Förmånstagare	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken Kundkod (upp till 50 alfanumeriska tecken).
14	Trepartsagent	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
15	Mäklare	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
16	Clearingmedlem	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
17	Deltagare eller indirekt deltagare i en värdepapperscentral	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
18	Ombud för en långivare	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken

(1) Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU av den 26 juni 2013 om behörighet att utöva verksamhet i kreditinstitut och om tillsyn av kreditinstitut och värdepappersföretag (EUT L 176, 27.6.2013, s. 338).
(2) Rådets förordning (EU) nr 1024/2013 av den 15 oktober 2013 om tilldelning av särskilda uppgifter till Europeiska centralbanken i fråga om politiken för tillsyn över kreditinstitut (EUT L 287, 29.10.2013, s. 63).
(3) Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).
(4) Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/138/EG av den 25 november 2009 om upptagande och utövande av försäkrings- och återförsäkringsverksamhet (Solvens II) (EUT L 335, 17.12.2009, s. 1).
(5) Europaparlamentets och rådets direktiv 2011/61/EU av den 8 juni 2011 om förvaltare av alternativa investeringsfonder (EUT L 174, 1.7.2011, s. 1).
(6) Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/41/EG av den 3 juni 2003 om verksamhet i och tillsyn över tjänstepensionsinstitut (EUT L 235, 23.9.2003, s. 10).
(7) 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).
(8) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 909/2014 av den 23 juli 2014 om förbättrad värdepappersavveckling i Europeiska unionen och om värdepapperscentraler (EUT L 257, 28.8.2014, s. 1).
(9) Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/65/EG av den 13 juli 2009 om samordning av lagar och andra författningar som avser företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag) (EUT L 302, 17.11.2009, s. 32).
(10) Europaparlamentets och rådets förordning (EG) nr 1893/2006 av den 20 december 2006 om fastställande av den statistiska näringsgrensindelningen Nace rev. 2 (EUT L 393, 30.12.2006, s. 1).

Tabell 2

Uppgifter om lån och säkerheter

Nr	Fält	Format
1	Unik transaktionskod (UTI)	Högst 52 alfanumeriska tecken inklusive 4 specialtecken: Endast alfabetiska versaler A–Z och siffrorna 0–9, även i kombination, är tillåtna.
2	Rapportens spårningsnummer	Högst 52 alfanumeriska tecken inklusive 4 specialtecken: Endast alfabetiska versaler A–Z och siffrorna 0–9, även i kombination, är tillåtna.
3	Datum	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
4	Typ av transaktion för värdepappersfinansiering	”SLEB” – utlåning av värdepapper eller råvaror, eller lån av värdepapper eller råvaror ”SBSC” – köp- och återförsäljningstransaktioner eller sälj- och återköpstransaktioner ”REPO” – återköpstransaktion ”MGLD” – marginalutlåning

Nr	Fält	Format
5	Clearad	”sant” ”falskt”
6	Clearing-tillfälle	Datumformat enligt ISO 8601/UTC-tid (koordinerad universell tid), format ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ
7	Central motpart	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
8	Handelsplats	MIC-kod enligt ISO 10383, 4 alfanumeriska tecken. Om MIC-koder förekommer per segment för en handelsplats ska dessa MIC-koder per segment användas.
9	Ramavtalstyp	”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 Kanada (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” – bilateralt avtal ”CSDA” – bilateralt avtal avseende värdepapperscentraler Eller ”OTHR” om ramavtalet inte finns förtecknat ovan
10	Annan ramavtalstyp	Upp till 50 alfanumeriska tecken.
11	Ramavtal version	ISO 8601, datumformat ÅÅÅÅ
12	Genomförande-tillfälle	Datumformat enligt ISO 8601/UTC-tid (koordinerad universell tid), format ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ
13	Valuteringsdag (startdatum)	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD

Nr	Fält	Format
14	Förfallodag (slutdatum)	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
15	Avslutandedag	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
16	Minimi-uppsägningstid	Fält för heltal, upp till 3 siffror.
17	Tidigaste återkallelse-dag	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
18	Indikator för allmän säkerhet	”SPEC” – specifik säkerhet ”GENE” – allmän säkerhet
19	Indikator för ”delivery by value”	”sant” ”falskt”
20	Metod för säkerhetsställande	”TTCA”– avtal om finansiell äganderättöverföring. ”SICA” – avtal om finansiell säkerhet ”SIUR” – avtal om finansiell säkerhet med användningsrätt
21	Utan fastställd löptid	”sant” ”falskt”
22	Frivilligt avslutande	”EGRN” – evergreen ”ETSB” – förlängningsbar ”NOAP” – ej tillämpligt

När det gäller marginalutlåning, ska beteckningarna i fälten 23–24 upprepas och fyllas i för varje valuta som används i marginallånet.

23	Fast ränta	Upp till 11 numeriska tecken, inbegripet 10 decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
24	Dagberäkningsmetod	Kod för dagberäkningsmetod: ”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 upp till 35 alfanumeriska tecken om dagberäkningsmetoden inte finns i förteckningen ovan.

Nr	Fält	Format
25	Rörlig ränta	Kod för rörligt ränteindex ”EONA” – EONIA ”EONS” – EONIA SWAPP ”EURI” – EURIBOR ”EUUS” – EURODOLLAR ”EUCH” – EuroSwiss ”GCFR” – GCF REPO ”ISDA” – ISDAFIX ”LIBI” – LIBID ”LIBO” – LIBOR ”MAAA” – Muni AAA ”PFAN” – Pfandbriefe ”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 (stats-) ”SWAP” – Swapp ”FUSW” – Terminsswapp Eller upp till 25 alfanumeriska tecken om referensräntan inte finns i förteckningen ovan.
26	Referensperiod för rörlig ränta – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för tidsangivelse för referensperioden: ”YEAR” – År ”MNTH” – Månad ”WEEK” – Vecka ”DAYS” – Dag
27	Referensperiod för rörlig ränta – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar referensperioden för den rörliga räntan. Upp till 3 numeriska tecken.
28	Betalningsfrekvens för rörlig ränta – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar: ”YEAR” – År ”MNTH” – Månad ”WEEK” – Vecka ”DAYS” – Dag
29	Betalningsfrekvens för rörlig ränta – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar. Upp till 3 numeriska tecken.

Nr	Fält	Format
30	Justeringssfrekvens för rörlig ränta – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga reporäntan: ”YEAR” – År ”MNTH” – Månad ”WEEK” – Vecka ”DAYS” – Dag
31	Justeringssfrekvens för rörlig ränta – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga reporäntan. Upp till 3 numeriska tecken.
32	Spread	Upp till 5 numeriska tecken.
33	Valutabelopp för marginalutlåning	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
34	Valuta för marginalutlåning	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.

Fälten 35 och 36 ska upprepas och fyllas i för varje justering av den rörliga räntan.

35	Justerad sats	Upp till 11 numeriska tecken, inbegripet 10 decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
36	Räntedatum	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
37	Kapitalbelopp på valuteringsdagen	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
38	Kapitalbelopp på förfallodagen	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
39	Valuta för kapitalbelopp	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
40	Typ av tillgång	”SECU” – Värdepapper ”COMM” - Råvaror
41	Identifiering av värdepapper	ISIN-kod enligt ISO 6166 med 12 alfanumeriska tecken.
42	Klassificering av ett värdepapper.	CFI-kod enligt ISO 10692, 6 alfabetiska tecken.

Om en råvara lånats ut eller lånats ska klassificeringen av den råvaran anges i fälten 43, 44 och 45.

43	Basprodukt	Endast värden i kolumnen ”Basprodukt” i tabellen över klassificering av råvaruderivat tillåts.

Nr	Fält	Format
44	Underprodukt	Endast värden i kolumnen ”Underprodukt” i tabellen över klassificering av råvaruderivat tillåts.
45	Ytterligare underprodukt	Enbart värden i kolumnen ”Ytterligare underprodukt” i tabellen över klassificering av råvaruderivat tillåts.
46	Volym eller nominellt belopp	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
47	Måttenhet	”KILO” – Kilogram, ”PIEC” – Stycke, ”TONS” – Ton, ”METR” – Meter, ”INCH” – Tum, ”YARD” – Yard, ”GBGA” – Brittisk gallon, ”GRAM” – Gram, ”CMET” – Centimeter, ”SMET” – Kvadratmeter, ”FOOT” – Fot, ”MILE” – Engelsk mil, ”SQIN” – Kvadrattum, ”SQFO” – Kvadratfot, ”SQMI” – Engelsk mil i kvadrat, ”GBOU” – Brittiskt ounce, ”USOU” – Amerikanskt ounce, ”GBPI” – Brittisk pint, ”USPI” – Amerikansk pint, ”GBQA” – Brittisk quart, ”USQA” – Amerikansk quart, ”USGA” – Amerikansk gallon, ”MMET” – Millimeter, ”KMET” – Kilometer, ”SQYA” – Kvadratyard, ”ACRE” – Acre, ”ARES” – Ar, ”SMIL” – Kvadratmilimeter, ”SCMT” – Kvadratcentimeter, ”HECT” – Hektar, ”SQKI” – Kvadratkilometer, ”MILI” – Mililiter, ”CELI” – Centiliter, ”LITR” – Liter, ”PUND” – Skålpund, ”ALOW” – Utsläppsrätt, ”ACCY” – Valutabelopp, ”BARL” – Fat, ”BCUF” – Miljard kubikfot, ”BDFT” – Plankfot (BoardFeet), ”BUSL” – Skäppor (Bushels), ”CEER” – CertifiedEmissionsReduction, ”CLRT” – ClimateReserveTonnes, ”CBME” – Kubikmeter, ”DAYS” – Dagar, ”DMET” – Ton torrvikt, ”ENVC” – EnvironmentalCredit, ”ENVO” – EnvironmentalOffset, ”HUWG” – Hundredweight, ”KWDC” – Kilowattdag-kapacitet, ”KWHO” – Kilowattimmar, ”KWHC” – Kilowatttimme-kapacitet, ”KMOC” – Kilowattminut-kapacitet, ”KWMC” – Kilowattmånad-kapacitet, ”KWYC” – Kilowattår-kapacitet, ”MWDC” – Megawattdag-kapacitet, ”MWHO” – Megawatttimme, ”MWHC” – Megawatttimme-kapacitet, ”MWMC” – Megawattminut-kapacitet, ”MMOC” – Megawattmånad-kapacitet, ”MWYC” – Megawattår-kapacitet, ”TONE” – Ton, ”MIBA” – Miljoner fat, ”MBTU” – En miljon Btu, ”OZTR” – TroyOunces, ”UCWT” – Amerikansk hundredweight, ”IPNT” – Indexpunkt, ”PWRD” – Kapitalbelopp för räntebärande instrument (PrincipalWithRelationToDebtInstrument) ”DGEU” – Diesel-gallon-ekvivalent ”GGEU” – Bensin-gallon-ekvivalent, ”TOCD” – Ton koldioxid.
48	Valuta för nominellt belopp	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
49	Pris på värdepapper eller råvara	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler om priset uttrycks som enheter. Upp till 11 numeriska tecken inklusive upp till 10 decimaler om priset uttrycks som procent eller avkastning. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
50	Prisvaluta	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.

Nr	Fält	Format
51	Kvalitet på värdepapper	”INVG” – Hög kvalitet (Investment grade) ”INVG” – Låg kvalitet (Non-investment grade) ”NOTR” – Ej kreditvärderat (Non-rated) ”NOAP” – Ej tillämpligt
52	Värdepapperets löptid	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
53	Emittentens jurisdiktion	ISO 3166-1 alfa-2 landskod 2 alfabetiska tecken.
54	Emittentens LEI-kod	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
55	Typ av värdepapper	”GOVS” – Statspapper ”SUNS” – Värdepapper som avser överstatliga organisationer samt byråer ”FIDE” - Räntebärande värdepapper (inbegripet säkerställda obligationer)emitterade av banker och andra finansinstitut ”FIDE” - Företagsobligationer (inbegripet säkerställda obligationer) emitterade av icke-finansiella företag ”SEPR” – Värdepapperiserade produkter (inbegripet CDO, CMBS, ABCP) ”MEQU” - Aktier som ingår i ett centralt index (inbegripet konvertibla obligationer) ”OEQU” - Andra egetkapitalinstrument (inbegripet konvertibla obligationer) ”OTHR”- Andra tillgångar (inklusive aktier i gemensamma fonder)
56	Lånebelopp	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
57	Marknadskurs	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
58	Fast rabattsats	Upp till 11 numeriska tecken, inbegripet 10 decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.
59	Rörlig rabattsats	Kod för rörligt ränteindex ”EONA” – EONIA ”EONS” – EONIA SWAPP ”EURI” – EURIBOR ”EUUS” – EURODOLLAR ”EUCH” – EuroSwiss ”GCFR” – GCF REPO ”ISDA” – ISDAFIX ”LIBI” – LIBID ”LIBO” – LIBOR ”MAAA” – Muni AAA ”PFAN” – Pfandbriefe ”TIBO” – TIBOR ”STBO” – STIBOR ”BBSW” – BBSW

Nr	Fält	Format
		”JIBA” – JIBAR ”BUBO” – BUBOR ”CDOR” – CDOR ”CIBO” – CIBOR ”MOSP” – MOSPRIM ”NIBO” – NIBOR ”PRBO” – PRIBOR ”TLBO” – TELBOR ”WIBO” – WIBOR ”TREA” – Treasury (stats-) ”SWAP” – Swapp ”FUSW” – Terminsswapp Eller upp till 25 alfanumeriska tecken om referensräntan inte finns i förteckningen ovan.
60	Referensperiod för rörlig rabattsats – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för tidsangivelse för referensperioden: ”YEAR” – År ”MNTH” – Månad ”WEEK” – Vecka ”DAYS” – Dag
61	Referensperiod för rörlig rabattsats – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar referensperioden för den rörliga rabattsatsen. Upp till 3 numeriska tecken.
62	Betalningsfrekvens för rörlig rabattsats – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar: ”YEAR” – År ”MNTH” – Månad ”WEEK” – Vecka ”DAYS” – Dag
63	Betalningsfrekvens för rörlig rabattsats – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar. Upp till 3 numeriska tecken.
64	Justeringsfrekvens för rörlig rabattsats – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga rabattsatsen: ”YEAR” – År ”MNTH” – Månad ”WEEK” – Vecka ”DAYS” – Dag
65	Justeringsfrekvens för rörlig rabattsats – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga rabattsatsen. Upp till 3 numeriska tecken.
66	Rabattsatsens spread	Upp till 5 numeriska tecken.
67	Låneavgift	Upp till 11 numeriska tecken, inbegripet 10 decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”.

Nr	Fält	Format
68	Exklusiva arrangemang	”sant” ”falskt”
69	Utestående marginallån	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
70	Basvaluta för utestående marginallån	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
71	Marknadsvärde på korta positioner	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
Uppgifter om säkerheter		
72	Indikator för värdepapperslån utan säkerhet	”sant” ”falskt”
73	Kollateralisering av nettoexponering	”sant” ”falskt”
74	Valuteringsdag för säkerheten	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
Om specifik säkerhet använts ska fälten 75–94 upprepas och anges för säkerhetskomponent, i tillämpliga fall.		
75	Typ av säkerhetskomponent	”SECU” – Värdepapper ”COMM” – Råvaror (endast för repor, värdepappers- eller råvarulån och köp- och återförsäljningstransaktioner) ”CASH” – Kontanter
Om kontanter använts som säkerhet ska detta anges i fälten 76 och 77.		
76	Belopp av kontantsäkerhet	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
77	Valuta för kontantsäkerhet	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
78	Identifiering av ett värdepapper som används som säkerhet	ISIN-kod enligt ISO 6166 med 12 alfanumeriska tecken.
79	Klassificering av ett värdepapper som används som säkerhet	CFI-kod enligt ISO 10692, 6 alfabetiska tecken.

Nr	Fält	Format
Om en råvara lånats använts som säkerhet ska klassificeringen av den råvaran anges i fälten 80, 81 och 82.		
80	Basprodukt	Endast värden i kolumnen ”Basprodukt” i tabellen över klassificering av råvaruderivat tillåts.
81	Underprodukt	Endast värden i kolumnen ”Underprodukt” i tabellen över klassificering av råvaruderivat tillåts.
82	Ytterligare underprodukt	Enbart värden i kolumnen ”Ytterligare underprodukt” i tabellen över klassificering av råvaruderivat tillåts.
83	Volym eller nominellt belopp av säkerhet	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
84	Måttenhet för säkerhet	”KILO” – Kilogram, ”PIEC” – Stycke, ”TONS” – Ton, ”METR” – Meter, ”INCH” – Tum, ”YARD” – Yard, ”GBGA” – Brittisk gallon, ”GRAM” – Gram, ”CMET” – Centimeter, ”SMET” – Kvadratmeter, ”FOOT” – Fot, ”MILE” – Engelsk mil, ”SQIN” – Kvadrattum, ”SQFO” – Kvadratfot, ”SQMI” – Engelsk mil i kvadrat, ”GBOU” – Brittiskt ounce, ”USOU” – Amerikanskt ounce, ”GBPI” – Brittisk pint, ”USPI” – Amerikansk pint, ”GBQA” – Brittisk quart, ”USQA” – Amerikansk quart, ”USGA” – Amerikansk gallon, ”MMET” – Millimeter, ”KMET” – Kilometer, ”SQYA” – Kvadratyard, ”ACRE” – Acre, ”ARES” – Ar, ”SMIL” – Kvadratmilimeter, ”SCMT” – Kvadratcentimeter, ”HECT” – Hektar, ”SQKI” – Kvadratkilometer, ”MILI” – Mililiter, ”CELI” – Centiliter, ”LITR” – Liter, ”PUND” – Skålpund, ”ALOW” – Utsläppsrätt, ”ACCY” – Valutabelopp, ”BARL” – Fat, ”BCUF” – Miljard kubikfot, ”BDFT” – Plankfot (BoardFeet), ”BUSL” – Skäppor (Bushels), ”CEER” – CertifiedEmissionsReduction, ”CLRT” – ClimateReserveTonnes, ”CBME” – Kubikmeter, ”DAYS” – Dagar, ”DMET” – Ton torrvikt, ”ENVC” – EnvironmentalCredit, ”ENVO” – EnvironmentalOffset, ”HUWG” – Hundredweight, ”KWDC” – Kilowattdag-kapacitet, ”KWHO” – Kilowattimmar, ”KWHC” – Kilowatttimme-kapacitet, ”KMOC” – Kilowattminut-kapacitet, ”KWMC” – Kilowattmånad-kapacitet, ”KWYC” – Kilowattår-kapacitet, ”MWDC” – Megawattdag-kapacitet, ”MWHO” – Megawatttimme, ”MWHC” – Megawatttimme-kapacitet, ”MWMC” – Megawattminut-kapacitet, ”MMOC” – Megawattmånad-kapacitet, ”MWYC” – Megawattår-kapacitet, ”TONE” – Ton, ”MIBA” – Miljoner fat, ”MBTU” – En miljon Btu, ”OZTR” – TroyOunces, ”UCWT” – Amerikansk hundredweight, ”IPNT” – Indexpunkt, ”PWRD” – Kapitalbelopp för räntebärande instrument (PrincipalWithRelationToDebtInstrument) ”DGEU” – Diesel-gallon-ekvivalent ”GGEU” – Bensin-gallon-ekvivalent, ”TOCD” – Ton koldioxid.
85	Valuta för nominellt belopp av säkerhet	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
86	Prisvaluta	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
87	Pris per enhet	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler om priset uttrycks i enheter. Upp till 11 numeriska tecken inklusive upp till 10 decimaler om priset uttrycks som procent eller avkastning. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.

Nr	Fält	Format
88	Marknadsvärde på säkerhet	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
89	Värderingsavdrag eller marginal	Upp till 11 numeriska tecken, inbegripet 10 decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
90	Kvalitet på säkerhet	”INVG” – Hög kvalitet (Investment grade) ”INVG” – Låg kvalitet (Non-investment grade) ”NOTR” – Ej kreditvärderat (Non-rated) ”NOAP” – Ej tillämpligt
91	Förfallodag för värdepapper	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
92	Emittentens jurisdiktion	ISO 3166-1 alfa-2 landskod 2 alfabetiska tecken.
93	Emittentens LEI-kod	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
94	Typ av säkerhet	”GOVS” – Statspapper ”SUNS” – Värdepapper som avser överstatliga organisationer samt byråer ”FIDE” – Räntebärande värdepapper (inbegripet säkerställda obligationer)emitterade av banker och andra finansinstitut ”FIDE” – Företagsobligationer (inbegripet säkerställda obligationer) emitterade av icke-finansiella företag ”SEPR” – Värdepapperiserade produkter (inbegripet CDO, CMBS, ABCP) ”MEQU” – Aktier som ingår i ett centralt index (inbegripet konvertibla obligationer) ”OEQU” – Andra egetkapitalinstrument (inbegripet konvertibla obligationer) ”OTHR”– Andra tillgångar (inklusive aktier i gemensamma fonder)
95	Möjlighet till återanvändning av säkerhet	”sant” ”falskt”

Fält 96 ska fyllas i om en korg av säkerheter använts. Den detaljerade allokeringen av säkerheter för transaktioner för värdepappersfinansiering som görs mot en säkerhetspool ska anges i fälten 75–94 i tillämpliga fall.

96	Identifiering av korg av säkerheter	ISIN-kod enligt ISO 6166 med 12 alfanumeriska tecken eller ”NTAV”
97	Portföljkod	52 alfanumeriska tecken inklusive 4 specialtecken: -‘ _. Specialtecken får inte användas i början och slutet av koden. Blanksteg får inte användas.
98	Åtgärdstyp	”NEWT” – Ny ”MODI” – Modifiering ”VALU” – Värdering ”COLU” – Uppdatering av säkerhet ”EROR” – Fel ”CORR” – Korrigering

Nr	Fält	Format
		”ETRM” – Avslutande/Tidigt avslutande ”POSC” - Positionskomponent
99	Nivå	”TCTN” – Transaktion ”PSTN” – Position

Tabell 3

Uppgifter om marginalsäkerhet

Nr	Fält	Format
1	Rapporteringstillfälle	Datumformat enligt ISO 8601/UTC-tid (koordinerad universell tid), format ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Datum	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
3	Rapporterande enhet	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
4	Rapporterande motpart	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
5	Rapporterande enhet	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
6	Den andra motparten	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
7	Portföljkod	52 alfanumeriska tecken inklusive 4 specialtecken: -‘ _. Specialtecken får inte användas i början och slutet av koden. Blanksteg får inte användas.
8	Ställd initialsäkerhet	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
9	Valuta för den initialsäkerhet som ställts	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
10	Ställd tilläggsmarginalsäkerhet	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
11	Valuta på den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts.	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
12	Erhållen initialsäkerhet	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
13	Valuta för den initialsäkerhet som erhållits	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
14	Tilläggsmarginalsäkerhet som erhållits	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.

Nr	Fält	Format
15	Valutan på den erhållna tillägsmarginalsäkerheten	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
16	Överskjutande säkerhet som ställts	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
17	Valuta för den överskjutande säkerhet som ställts	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
18	Överskjutande säkerhet som erhållits	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
19	Valuta för den överskjutande säkerhet som erhållits	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
20	Åtgärdstyp	”NEWT” – Ny ”MARU” – Uppdatering av marginalsäkerhet ”EROR” – Fel ”CORR” – Korrigering

Tabell 4

Återanvändning, återinvestering av kontanter och uppgifter om finansieringskällor

Nr	Fält	Format
1	Rapporteringstillfälle	Datumformat enligt ISO 8601/UTC-tid, format ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Datum	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD
3	Rapporterande enhet	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
4	Rapporterande motpart	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
5	Rapporterande enhet	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
Fält 6 ska upprepas och fyllas i för varje justering av säkerhetskomponenten.		
6	Typ av säkerhetskomponent	”SECU” – Värdepapper ”CASH” – Kontanter
Fälten 7, 8, 9 och 10 ska upprepas och fyllas i för varje justering av säkerhetskomponenten.		
7	Säkerhets-komponent	ISIN-kod enligt ISO 6166 med 12 alfanumeriska tecken.
8	Värde på återanvända säkerheter	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
9	Uppskattad återanvändning av säkerheter	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.

Nr	Fält	Format
10	Valuta för återanvänd säkerhet	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
11	Återinvesteringstakt	Upp till 11 numeriska tecken, inbegripet 10 decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”.
Fälten 12, 13 och 14 ska upprepas och fyllas i för varje investering där kontantsäkerhet har återinvesterats, och för varje valuta.		
12	Typ av återinvesterad kontantsäkerhet	”MMFT” – registrerad penningmarknadsfond ”OCMP” – annan blandad pool ”REPM” – repomarknaden ”SDPU” – direkt köp av värdepapper ”OTHR” – övrigt
13	Återinvesterat kontantbelopp	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
14	Valuta för återinvesterat kontantbelopp	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
Vid marginalutlåning ska motparten upprepa och fylla i fälten 15, 16 och 17 för varje finansieringskälla samt lämna information i dessa fält på enhetsnivå.		
15	Finansieringskällor	”REPO” – repor eller köp- och återförsäljningstransaktioner ”SECL”– kontantsäkerhet från värdepappersutlåning ”FREE” - kostnadsfria krediter ”CSHS” – Inkomster från kunders blankningsaffärer ”BSHS” – Inkomster från mäklares blankningsaffärer ”UBOR” – lån utan säkerhet ”OTHR” – övrigt
16	Finansieringskällans marknadsvärde	Upp till 18 numeriska tecken inklusive upp till 5 decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om ej möjligt, pro rata-belopp
17	Valuta för finansieringskällor	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken.
18	Åtgärdstyp	”NEWT” – Ny ”REUU” – Uppdatering av återanvändning ”EROR” – Fel ”CORR” – Korrigering

Tabell 5

Klassificering av råvaror

Basprodukt	Underprodukt	Ytterligare underprodukt
”AGRI” – Jordbruksprodukter	”GROS” – Spannmål, Oljeväxtfrön	”FWHT” – Fodervete ”SOYB” – Sojabönor ”CORN” – Majs ”RPSD” – Raps ”RICE” – Ris ”OTHR” – Övrigt

Basprodukt	Underprodukt	Ytterligare underprodukt
	”SOFT” – Jordbruksprodukter	”CCOA” – Kakao ”ROBU” – Robustakaffe ”WHSG” – Vitt socker ”BRWN” – Råsocker ”OTHR” – Övrigt
	”POTA” – Potatis	
	”OOLI”– Olivolja	”LAMP” – Bomolja ”OTHR” – Övrigt
	”DIRY” – Mejeriprodukter	
	”FRST” – Skogsbruksprodukter	
	”SEAF” – Fisk och skaldjur	
	”LSTK” – Djur	
	”GRIN” – Spannmål	”MWHT” – Vete för malning ”OTHR” – Övrigt
	”OTHR” – Övrigt	
”NRGY” –Energi	”ELEC” – Elektricitet	”BSLD” – Baslast ”FITR” – Finansiella överföringsrättigheter ”PKLD” – Höglast ”OFFP” – Låglast ”OTHR” – Övrigt
	”NGAS” – Naturgas	”GASP” – GASPOOL ”LNGG” – LNG ”NBPG” – NBP ”NCGG” – NCG ”TTFG” – TTF ”OTHR” – Övrigt
	”OILP” – Olja	”BAKK” – Bakken ”BDSL” – Biodiesel ”BRNT” – Brent ”BRNX” – Brent NX ”CNDA” – Kanadensisk ”COND” – Kondensat ”DSEL” – Diesel ”DUBA” – Dubai ”ESPO” – ESPO ”ETHA” – Etanol ”FUEL” – Bränsle ”FOIL” – Brännolja ”GOIL” – Gasolja

Basprodukt	Underprodukt	Ytterligare underprodukt
		”GSLN” – Bensin ”HEAT” – Eldningsolja ”JTFL” – Flygbränsle ”KERO” – Fotogen ”LLSO” – Light Louisiana Sweet (LLS) ”MARS” – Mars ”NAPH” – Nafta ”NGLO” – NGL ”TAPI” – Tapis ”URAL” – Urals ”WTIO” – WTI ”OTHR” – Övrigt
	”COAL”– Kol ”INRG” – Inter Energy ”RNNG” – Förnybar energi ”LGHT” – Lätta produkter ”DIST” – Destillat ”OTHR” – Övrigt	
”ENVR” – Miljörelaterade	”EMIS” – Utsläpp	”CERE” – CER ”ERUE” – ERU ”EUAE” – EUA ”EUAA” – EUAA ”OTHR” – Övrigt
	”WTHR” – Väder ”CRBR” – ”Kolrelaterat” ”OTHR” – Övrigt	
”FRGT” – Transport	”WETF” – Våt	”TNKR” – Tanker ”OTHR” – Övrigt
	”DRYF” – Torr	”DBCR” – Bulkfartyg ”OTHR” – Övrigt
	”CSHP” – Containerfartyg	
	”OTHR” – Övrigt	
”FRTL” – Gödningsmedel	”AMMO” – Ammoniak ”DAPH” – DAP (Diammoniumfosfat) ”PTSH” – Kaliumkarbonat ”SLPH” – Svavel ”UREA” – Urea ”UAAN” – UAN (urea och ammoniumnitrat) ”OTHR” – Övrigt	

Basprodukt	Underprodukt	Ytterligare underprodukt
”INDP” – Industriprodukter	”CSTR” – Konstruktion ”MFTG” – Tillverkning	
”METL” – Metaller	”NPRM” – Oädla	”ALUM” – Aluminium ”ALUA” – Aluminiumlegering ”CBLT” – Kobolt ”COPR” – Koppar ”IRON” – Järnmalm ”LEAD” – Bly ”MOLY” – Molybden ”NASC” – NASAAC ”NICK” – Nickel ”STEL” – Stål ”TINN” – Tenn ”ZINC” – Zink ”OTHR” – Övrigt
	”PRME” – Ädla	”GOLD” – Guld ”SLVR” – Silver ”PTNM” – Platina ”PLDM” – Palladium ”OTHR” – Övrigt
”MCEX” – Flera varor exotisk		
”PAPR” – Papper	”CBRD” – Lådkartong ”NSPT” - Tidningspapper ”PULP” – Pappersmassa ”RCVP” – Returpapper ”OTHR” – Övrigt	
”POLY” – Polypropylen	”PLST” – Plast ”OTHR” – Övrigt	
”INFL” – Inflation		
”OEST” – Officiell ekonomisk statistik		
”OTHC” – Övrigt C10 enligt definitionen i tabell 10.1 i avsnitt 10 i bilaga III till kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/583 [1]		
”OTHR” – Övrigt		

[1] Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/583 av den 14 juli 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska tillsynsstandarder när det gäller krav på transparens för handelsplatser och värdepappersföretag för obligationer, strukturerade finansiella produkter, utsläppsrätter och derivat (EUT L 87, 31.3.2017, s. 229).

BILAGA II

Bilagan till genomförandeförordning (EU) nr 1247/2012 ska ersättas med följande:

”*BILAGA*

Tabell 1

Motpartsuppgifter

	Fält	Format
	Kontraktets parter	
1	Rapporteringstillfälle	Datumformat enligt ISO 8601/UTC-tid (koordinerad universell tid), format ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Den rapporterande motpartens ID	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
3	Den andra motpartens typ av ID	”LEI” för ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 ”CLC” för kundkod
4	Den andra motpartens ID	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken Kundkod (upp till 50 alfanumeriska tecken)
5	Den andra motpartens land	Landskod med 2 tecken enligt ISO 3166
6	Den rapporterande motpartens bransch	Taxonomi för finansiella motparter: A = försäkringsföretag som auktoriserats i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/138/EG ([1]) C = kreditinstitut som auktoriserats i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU ([2]). F = värdepappersföretag som auktoriserats i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2004/39/EG ([3]). I = försäkringsföretag som auktoriserats i enlighet med direktiv **2009/138/EG** L = alternativ investeringsfond förvaltad av en AIF-förvaltare som auktoriserats eller registrerats i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2011/61/EU ([4]). O = tjänstepensionsinstitut i den mening som avses i artikel 6 a i Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/41/EG ([5]) . R = återförsäkringsföretag som auktoriserats i enlighet med direktiv 200/138/EG U = företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag) och dess förvaltningsbolag som auktoriserats i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/65/EG ([6]). Taxonomi för icke-finansiella motparter: Följande kategorier motsvarar huvudavdelningarna i statistisk näringsgrensindelning i Europeiska gemenskapen (Nace) enligt Europaparlamentets och rådets förordning (EG) nr 1893/2006 ([7]). 1 = Jordbruk, skogsbruk och fiske 2 = Utvinning av mineral 3 = Tillverkning 4 = Försörjning av el, gas, värme och kyla

	Fält	Format
		5 = Vattenförsörjning, avloppsrening, avfallshantering och sanering 6 = Byggverksamhet 7 = Partihandel och detaljhandel; reparation av motorfordon och motorcyklar 8 = Transport och magasinering 9 = Hotell- och restaurangverksamhet 10 = Informations- och kommunikationsverksamhet 11 = Finans- och försäkringsverksamhet 12 = Fastighetsverksamhet 13 = Verksamhet inom juridik, ekonomi, vetenskap och teknik 14 = Uthyrning, fastighetsservice, resetjänster och andra stödtjänster 15 = Offentlig förvaltning och försvar; obligatorisk socialförsäkring 16 = Utbildning 17 = Vård och omsorg; sociala tjänster 18 = Kultur, nöje och fritid 19 = Annan serviceverksamhet 20 = Förvärvsarbete i hushåll; hushållens produktion av diverse varor och tjänster för eget bruk 21 = Verksamhet vid internationella organisationer, utländska ambassader o.d. Om mer än en verksamhet rapporteras, ange koderna i prioritetsordning efter verksamheternas relativa betydelse, åtskilda av ett bindestreck ”-”. Lämna fältet tomt för centrala motparter och andra motparter i enlighet med artikel 1.5 i förordning (EU) nr 648/2012.
7	Rapporterande motparts typ	F = Finansiell motpart N = Icke-finansiell motpart C = Central motpart O = Annan
8	Mäklar-ID	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
9	Den rapporterande enhetens ID	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
10	Clearingmedlems ID	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken
11	Förmånstagares typ av ID	”LEI” för ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 ”CLC” för kundkod
12	Förmånstagares ID	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken eller kundkod med upp till 50 alfanumeriska tecken i fall där kunden inte är berättigad till ID för juridiska personer
13	Handelskapacitet	P = Uppdragsgivare A = Ombud
14	Motpartssida	B = Köpare S = Säljare Fylls i i enlighet med artikel 3a

	Fält	Format
15	Direkt kopplat till affärsverksamhet eller likviditetsförvaltning	Y = Ja N = Nej
16	Clearingtröskel	Y = Över N = Under
17	Kontraktets värde	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.
18	Värderingsvaluta	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken
19	Tidsangivelse för värdering	ISO 8601 datum uttryckt i UCT-tid ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ
20	Värderingstyp	M = Uppdaterat marknadsvärde (mark-to-market) O = Modellberäknat värde (mark-to-model) C = Central motparts värdering
21	Ställande av säkerhet	U = Utan ställd säkerhet PC = Delsäkerhet ställd OC = Enkel säkerhet ställd FC = Hel säkerhet ställd Fylls i i enlighet med artikel 3b
22	Säkerhetsportfölj	Y = Ja N = Nej
23	Säkerhetsportföljkod	Högst 52 alfanumeriska tecken inklusive 4 specialtecken:". - _." Specialtecken får inte användas i början och slutet av koden. Blanksteg får inte användas.
24	Ställd initialsäkerhet	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
25	Valuta för den initialsäkerhet som ställts	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken
26	Ställd tilläggsmarginalsäkerhet	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
27	Valuta för den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken
28	Erhållen initialsäkerhet	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
29	Valuta för den initialsäkerhet som erhållits	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken

	Fält	Format
30	Tilläggsmarginalsäkerhet som erhållits	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
31	Valuta för den tilläggsmarginalsäkerhet som erhållits	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken
32	Överskjutande säkerhet som ställts	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
33	Valuta för den överskjutande säkerhet som ställts	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken
34	Överskjutande säkerhet som erhållits	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.
35	Valuta för den överskjutande säkerhet som erhållits	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken

(1) Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/138/EG av den 25 november 2009 om upptagande och utövande av försäkrings- och återförsäkringsverksamhet (Solvens II) (EUT L 335, 17.12.2009, s. 1).
(2) Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU av den 26 juni 2013 om behörighet att utöva verksamhet i kreditinstitut och om tillsyn av kreditinstitut och värdepappersföretag, om ändring av direktiv 2002/87/EG och om upphävande av direktiv 2006/48/EG och 2006/49/EG (EUT L 176, 27.6.2013, s. 338).
(3) Europaparlamentets och rådets direktiv 2004/39/EG av den 21 april 2004 om marknader för finansiella instrument och om ändring av rådets direktiv 85/611/EEG och 93/6/EEG och Europaparlamentets och rådets direktiv 2000/12/EG samt upphävande av rådets direktiv 93/22/EEG (EUT L 145, 30.4.2004, s. 1).
(4) Europaparlamentets och rådets direktiv 2011/61/EU av den 8 juni 2011 om förvaltare av alternativa investeringsfonder samt om ändring av direktiv 2003/41/EG och 2009/65/EG och förordningarna (EG) nr 1060/2009 och (EU) nr 1095/2010 (EUT L 174, 1.7.2011, s. 1).
(5) Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/41/EG av den 3 juni 2003 om verksamhet i och tillsyn över tjänstepensionsinstitut (EUT L 235, 23.9.2003, s. 10).
(6) Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/65/EG av den 13 juli 2009 om samordning av lagar och andra författningar som avser företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag) (EUT L 302, 17.11.2009, s. 32).
(7) Europaparlamentets och rådets förordning (EG) nr 1893/2006 av den 20 december 2006 om fastställande av den statistiska näringsgrensindelningen Nace rev. 2 och om ändring av rådets förordning (EEG) nr 3037/90 och vissa EG-förordningar om särskilda statistikområden (EUT L 393, 30.12.2006, s. 1).

Tabell 2

Gemensamma uppgifter

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
	Avsnitt 2a – kontraktstyp		Alla kontrakt
1	Typ av kontrakt	CD = CFD-kontrakt (”contracts for difference”) FR = Ränteterminskontrakt (”forward rate agreements”, FRA) FU = Terminskontrakt (”futures”) FW = Terminskontrakt (”forwards”) OP = Optioner SB = Spreadbetkontrakt SW = Swappar ST = Swapoptioner OT = Övrigt	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
2	Tillgångsklass	CO = Råvaror och utsläppsrätter CR = Kredit CU = Valuta EQ = Aktier IR = Ränta	
	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet		Alla kontrakt
3	Typ av produktklassificering	C = CFI-kod	
4	Produktklassificering	CFI-kod enligt ISO 10692, 6 alfabetiska tecken	
5	Typ av produktidentifiering	Ange tillämplig identifiering: I = ISIN-kod A = AII-kod	
6	Produktidentifiering	För produkt-ID typ I: ISIN-kod enligt ISO 6166 med 12 alfanumeriska tecken För produkt-ID typ A: Fullständig AII-kod	
7	Typ av identifiering för den underliggande komponenten	I = ISIN-kod A = AII-kod B = Korg X = Index	
8	Identifiering av det underliggande	För underliggande med ID typ I: ISIN-kod enligt ISO 6166 med 12 alfanumeriska tecken För underliggande med ID typ A: Fullständig AII-kod För underliggande med ID typ B: identifiering av alla enskilda beståndsdelar genom ISIN-kod enligt ISO 6166 eller fullständig AII-kod Identifieringskoder för enskilda komponenter ska åtskiljas med bindestreck ”-”. För underliggande med ID typ X: ISIN-kod enligt ISO 6166 om sådan finns, i annat fall fullständigt namn på index enligt vad som angetts av den som tillhandahåller indexet	
9	Teoretisk valuta 1	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken	
10	Teoretisk valuta 2	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken	
11	Utdelningsvaluta	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken	
	Avsnitt 2c – Detaljerade uppgifter om transaktionen		Alla kontrakt
12	Transaktions-ID	Högst 52 alfanumeriska tecken inklusive 4 specialtecken:”. - _.” Specialtecken får inte användas i början och slutet av koden. Blanksteg får inte användas.	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
13	Rapportens spårningsnummer	Högst 52 alfanumeriska tecken	
14	Komponent-ID för komplex handel	Högst 35 alfanumeriska tecken	
15	Handelsplats	MIC-kod enligt ISO 10383, 4 alfanumeriska tecken, i enlighet med artikel 4 b.	
16	Kompression	Y = kontraktet är ett resultat av kompression N = kontraktet är inte ett resultat av kompression	
17	Pris / andel	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken. Om priset rapporteras i procent ska det uttryckas som en procentandel där 100 % anges med ”100”	
18	Prisnotering	U = Enheter P = Procentsats Y = Avkastning	
19	Prisets valuta	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken	
20	Teoretiskt värde	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	
21	Prismultiplikator	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.	
22	Kvantitet	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.	
23	Förskottsbetalning	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. En negativ symbol används för att ange att betalning har gjorts, inte mottagits. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
24	Typ av leverans	C = Kontant P = Fysisk O = Frivillig för motparten eller när det fastställs av en tredje part	
25	Genomförandetidpunkt	ISO 8601 datum uttryckt i UCT-tid ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ	
26	Ikraftträdande	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD	
27	Förfallodag	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD	
28	Avslutandedag	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD	
29	Avvecklingsdag	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD	
30	Ramavtalstyp	Fritext med identifiering av eventuellt ramavtal (högst 50 tecken)	
31	Ramavtalsversion	ISO 8601, datumformat ÅÅÅÅ	
	Avsnitt 2d – Riskreducering / riskrapportering		Alla kontrakt
32	Bekräftelsetillfälle	ISO 8601 datum uttryckt i UCT-tid ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ	
33	Bekräftelsesätt	Y = Icke-elektronisk bekräftelse N = Ingen bekräftelse E = Elektronisk bekräftelse	
	Avsnitt 2e – Clearing		Alla kontrakt
34	Clearingkrav	Y = Ja N = Nej	
35	Clearad	Y = Ja N = Nej	
36	Clearingtidpunkt	ISO 8601 datum uttryckt i UCT-tid ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ	
37	Central motpart	ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 Kod med 20 alfanumeriska tecken	
38	Inom gruppen	Y = Ja N = Nej	
	Avsnitt 2f – Räntor		Räntederivat
39	Fast ränta ben 1	Upp till 10 numeriska tecken, inbegripet decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”.	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
		Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	
40	Fast ränta ben 2	Upp till 10 numeriska tecken, inbegripet decimaler uttryckt som en procentandel där 100 % anges med ”100”. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	
41	Period med fast ränta ben 1	Täljare/nämnare där både täljaren och nämnaren är numeriska tecken eller med uttrycket ”Actual”, t.ex. 30/360 eller Actual/365	
42	Period med fast ränta ben 2	Täljare/nämnare där både täljaren och nämnaren är numeriska tecken eller med uttrycket ”Actual”, t.ex. 30/360 eller Actual/365	
43	Betalningsfrekvens för fast ränta ben 1 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
44	Betalningsfrekvens för fast ränta ben 1 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar. Upp till 3 numeriska tecken.	
45	Betalningsfrekvens för fast ränta ben 2 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
46	Betalningsfrekvens för fast ränta ben 2 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar. Upp till 3 numeriska tecken.	
47	Betalningsfrekvens för rörlig ränta ben 1 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
48	Betalningsfrekvens för rörlig ränta ben 1 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar. Upp till 3 numeriska tecken.	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
49	Betalningsfrekvens för rörlig ränta ben 2 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
50	Betalningsfrekvens för rörlig ränta ben 2 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna utbyter betalningar. Upp till 3 numeriska tecken.	
51	Justeringsfrekvens för rörlig ränta ben 1 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga räntan: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
52	Justeringsfrekvens för rörlig ränta ben 1 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga räntan Upp till 3 numeriska tecken.	
53	Justeringsfrekvens för rörlig ränta ben 2 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för att ange den tidsperiod som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga räntan: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
54	Justeringsfrekvens för rörlig ränta ben 2 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar hur ofta motparterna justerar den rörliga räntan Upp till 3 numeriska tecken.	
55	Rörlig ränta ben 1	Namn på det rörliga ränteindexet ”EONA” – EONIA ”EONS” – EONIA-SWAPP ”EURI” – EURIBOR ”EUUS” – EURODOLLAR ”EUCH” – EuroSwiss ”GCFR” – GCF REPO ”ISDA” – ISDAFIX ”LIBI” – LIBID ”LIBO” – LIBOR ”MAAA” – Muni AAA ”PFAN” – Pfandbriefe ”TIBO” – TIBOR ”STBO” – STIBOR ”BBSW” – BBSW	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
		”JIBA” – JIBAR ”BUBO” – BUBOR ”CDOR” – CDOR ”CIBO” – CIBOR ”MOSP” – MOSPRIM ”NIBO” – NIBOR ”PRBO” – PRIBOR ”TLBO” – TELBOR ”WIBO” – WIBOR ”TREA” – Treasury (stats-) ”SWAP” – Swapp ”FUSW” – Terminsswapp Eller upp till 25 alfanumeriska tecken om referensräntan inte finns i förteckningen ovan.	
56	Referensperiod för rörlig ränta ben 1 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för tidsangivelse för referensperioden: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
57	Referensperiod för rörlig ränta ben 1 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar referensperioden Upp till 3 numeriska tecken.	
58	Rörlig ränta ben 2	Namn på det rörliga ränteindexet ”EONA” – EONIA ”EONS” – EONIA-SWAPP ”EURI” – EURIBOR ”EUUS” – EURODOLLAR ”EUCH” – EuroSwiss ”GCFR” – GCF REPO ”ISDA” – ISDAFIX ”LIBI” – LIBID ”LIBO” – LIBOR ”MAAA” – Muni AAA ”PFAN” – Pfandbriefe ”TIBO” – TIBOR ”STBO” – STIBOR ”BBSW” – BBSW ”JIBA” – JIBAR ”BUBO” – BUBOR ”CDOR” – CDOR ”CIBO” – CIBOR ”MOSP” – MOSPRIM ”NIBO” – NIBOR ”PRBO” – PRIBOR	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
		”TLBO” – TELBOR ”WIBO” – WIBOR ”TREA” – Treasury (stats-) ”SWAP” – Swapp ”FUSW” – Terminsswapp Eller upp till 25 alfanumeriska tecken om referensräntan inte finns i förteckningen ovan.	
59	Referensperiod för rörlig ränta ben 2 – periodangivelse	Följande förkortningar ska användas för tidsangivelse för referensperioden: Y = År M = Månad W = Vecka D = Dag	
60	Referensperiod för rörlig ränta ben 2 – multiplikator	En multiplikator uttryckt i heltal som visar referensperioden Upp till 3 numeriska tecken.	
	Avsnitt 2g – Utländsk valuta		Valutaderivat
61	Leveransvaluta 2	Valutakod enligt ISO 4217, 3 alfabetiska tecken	
62	Växelkurs 1	Upp till 10 numeriska tecken, inbegripet decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	
63	Terminsväxelkurs	Upp till 10 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	
64	Valutakombination	Två valutakoder enligt ISO 4217, åtskilda av ”/” Den första valutakoden anger basvalutan och den andra valutakoden anger motvalutan.	
	Avsnitt 2h – Råvaror och utsläppsrätter		Råvaruderivat och utsläppsrättsderivat
	Allmänt		
65	Råvarubas	AG = Jordbruk EN = Energi	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
		FR = Frakter ME = Metaller IN = Index EV = Miljörelaterad EX = Exotisk OT = Övrigt	
66	Uppgifter om råvaran	*Jordbruksursprung* GO = Oljeväxtfrön DA = Mjölkprodukter LI = Djur FO = Skogsbruk SO = Jordbruksprodukter SF = Fisk och skaldjur OT = Övrigt *Energi* OI = Olja NG = Naturgas CO = Kol EL = Elekticitet IE = Kombinerade energislag OT = Övrigt *Frakter* DR = Bulk WT = Våt OT = Övrigt *Metaller* PR = Ädla NP = Oädla *Miljörelaterad* WE = Väder EM = Utsläpp OT = Övrigt	
	Energi		
67	Leveransställe eller zon	EIC-kod, 16 alfanumeriska tecken. Fältet kan upprepas.	
68	Förbindelsepunkt	EIC-kod, 16 alfanumeriska tecken.	
69	Belastningstyp	BL = Baslast PL = Höglast OP = Låglast BH = Timme/timblock SH = Form GD = Gasdygn OT = Övrigt	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
	Avsnittet kan upprepas för fälten 70–77		
70	Leveransintervall för last	tt:mmZ	
71	Leveransens startdatum och starttid	ISO 8601 datum uttryckt i UCT-tid ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ	
72	Leveransens slutdatum och sluttid	ISO 8601 datum uttryckt i UCT-tid ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ssZ	
73	Löptid	N = Minuter H = Timme D = Dag W = Vecka M = Månad Q = Kvartal S = Säsong Y = År O = Annat	
74	Veckodagar	WD = Vardagar WN = Helg MO = Måndag TU = Tisdag VE = Onsdag TH = Torsdag FR = Fredag SA = Lördag SU = Söndag Flera värden kan anges, separerade med ”/”	
75	Leveranskapacitet	Upp till 20 numeriska tecken, inbegripet decimaler Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	
76	Kvantitetsmått	KW KWh/h KWh/d MW MWh/h MWh/d GW GWh/h GWh/d	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
		Therm/d KTherm/d MTherm/d cm/d mcm/d	
77	Pris på tidsintervallens kvantiteter	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken.	
	Avsnitt 2i – Optioner		Avtal som innehåller en option
78	Optionsslag	P = Säljoption C = Köpoption O = Då det inte kan fastställas om det är en köp- eller säljoption	
79	Typ av optionsinlösen	A = Amerikansk typ B = Bermudatyp E = Europeisk typ S = Asiatisk typ Mer än ett värde kan anges	
80	Lösenpris (övre/lägre gräns)	Upp till 20 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt. Om minustecken används ska det inte räknas som ett numeriskt tecken. Om lösenpriset rapporteras i procent ska det uttryckas som en procentandel där 100 % anges med ”100”	
81	Lösenprisnotering	U = Enheter P = Procentsats Y = Avkastning	
82	Förfallodag för det underliggande	ISO 8601 datumformat ÅÅÅÅ-MM-DD	
	Sektion 2j – Kreditderivat		
83	Prioritet	SNDB = Prioriterad, t.ex. prioriterade osäkrade skulder (företag/finansiella), statspapper i utländsk valuta (statlig)	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
		SBOD = Efterställd, t.ex. efterställda skulder eller lägre sekundärkapitalskulder (banker), efterställda skulder med sämre förmånsrätt eller övre sekundärkapitalskulder (banker) OTHR = Övrigt, såsom preferensaktier eller primärkapital (banker) eller andra kreditderivat	
84	Referensenhet	Landskod med 2 tecken enligt ISO 3166 eller ISO 3166–2 – Landskod med 2 tecken, följt av ett bindestreck ”–” och kod för distrikt med upp till 3 alfanumeriska tecken eller ID för juridiska personer (LEI) enligt ISO 17442 med 20 alfanumeriska tecken	
85	Betalningsfrekvens	MNTH = Månatlig QURT = Kvartalsvis MIAN = Halvårsvis YEAR = Årlig	
86	Beräkningsgrund	Täljare/nämnare där både täljaren och nämnaren är numeriska tecken eller med uttrycket ”Actual”, t.ex. 30/360 eller Actual/365	
87	Serier	Fält för heltal, upp till 5 alfanumeriska tecken	
88	Version	Fält för heltal, upp till 5 alfanumeriska tecken	
89	Indexfaktor	Upp till 10 numeriska tecken inklusive decimaler. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.	
90	Tranch	T = Trancher U = Inga trancher	
91	Attachment point	Upp till 10 numeriska tecken, inbegripet decimaler, uttryckt som ett decimaltal mellan 0 och 1. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.	
92	Detachment point	Upp till 10 numeriska tecken, inbegripet decimaler, uttryckt som ett decimaltal mellan 0 och 1. Decimaltecknet ska inte räknas som ett numeriskt tecken. Om sådant tecken används ska det utgöras av en punkt.	
	Avsnitt 2k – Ändringar av kontraktet		
93	Åtgärdstyp	N = Ny M = Ändring	

	Fält	Format	Tillämpliga typer av derivatkontrakt
		E = Fel C = Förtida uppsägning R = Rättelse Z = Kompression V = Värderingsuppdatering P = Positionskomponent	
94	Nivå	T = Handel P = Position”	