GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) 2019/358 VAN DE COMMISSIE

van 13 december 2018

tot aanvulling van Verordening (EU) 2015/2365 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen betreffende de verzameling, verificatie, aggregatie, vergelijking en publicatie van gegevens over effectenfinancieringstransacties door transactieregisters

(Voor de EER relevante tekst)

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) 2015/2365 van het Europees Parlement en de Raad van 25 november 2015 betreffende de transparantie van effectenfinancieringstransacties en van hergebruik en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 ([1]), en met name artikel 5, lid 7, onder a), en artikel 12, lid 3, onder a) en b),

Overwegende hetgeen volgt:

(1) Teneinde te garanderen dat gegevens van hoge kwaliteit over effectenfinancieringstransacties (securities financing transactions, SFT's) aan transactieregisters worden gerapporteerd, moeten deze registers de identiteit van de rapporterende entiteiten, de logische integriteit van de volgorde waarin de SFT-gegevens worden gerapporteerd, en de volledigheid en juistheid van deze SFT-gegevens verifiëren.

(2) Om dezelfde reden moeten transactieregisters de gegevens van elke ontvangen SFT-rapportage op elkaar afstemmen. Er moet een standaardprocedure worden vastgesteld opdat transactieregisters de afstemming op consistente wijze kunnen uitvoeren, alsook om het risico te beperken dat SFT-gegevens niet op elkaar worden afgestemd. Bepaalde SFT-gegevens kunnen mogelijk echter niet identiek zijn als gevolg van de specifieke kenmerken van de informatietechnologiesystemen die door de rapporterende entiteiten worden gebruikt. Daarom dienen bepaalde toleranties te worden toegepast, zodat minieme verschillen in de gerapporteerde SFT-gegevens de autoriteiten niet beletten de gegevens met voldoende betrouwbaarheid te analyseren.

(3) Er mag worden verwacht dat de rapporterende entiteiten hun rapportage mettertijd zullen verbeteren, zowel in termen van een vermindering van het aantal verworpen rapportages als in termen van op elkaar afgestemde rapportages. Er moet hun echter voldoende tijd worden gegund om zich aan de rapportagevereisten aan te passen, met name om te voorkomen dat er zich onmiddellijk na de inwerkingtreding van de rapportageverplichting een opeenstapeling van niet-afgestemde transacties voordoet. Het is daarom raadzaam dat in een eerste fase slechts een beperkt aantal velden op elkaar moet worden afgestemd.

(4) Rapporterende entiteiten en, in voorkomend geval, voor de rapportage verantwoordelijke autoriteiten moeten in staat zijn hun naleving van hun rapportageverplichtingen uit hoofde van Verordening (EU) 2015/2365 te controleren. Zij moeten bijgevolg dagelijks toegang kunnen krijgen tot bepaalde informatie over deze rapportages, met inbegrip van zowel de uitkomst van de verificatie van deze rapportages, als de vooruitgang die bij de afstemming van de gerapporteerde gegevens is geboekt. Daarom is het noodzakelijk te specificeren welke informatie een transactieregister aan het einde van elke werkdag ter beschikking van deze entiteiten moet stellen.

(5) Teneinde de integriteit van de SFT-gegevens te bevorderen, moet de in artikel 12, lid 2, van Verordening (EU) 2015/2365 bedoelde rechtstreekse en onmiddellijke toegang op geharmoniseerde en consistente wijze worden verleend. Teneinde de rapportage te standaardiseren, de kosten voor de sector tot een minimum te beperken en voor alle transactieregisters de vergelijkbaarheid en de consistente aggregatie van gegevens te garanderen, verdient het aanbeveling dat voor alle outputverslagen en uitwisselingen templates in XML-formaat worden gebruikt en tevens een methode wordt gevolgd die algemeen gangbaar is in de financiële sector.

(6) Het is van essentieel belang dat toegang wordt geboden tot gegevens over posities tussen twee gegeven tegenpartijen om de in artikel 12, lid 2, van Verordening (EU) 2015/2365 genoemde entiteiten in staat te stellen potentiële oorzaken van systeem- of niet-systeemrisico's voor de financiële stabiliteit te onderkennen.

(7) Om het publiek voldoende transparantie te bieden ten aanzien van SFT's, moeten de criteria die voor de aggregatie van posities worden gehanteerd, het grote publiek in staat stellen zich een beeld te vormen van de

([1]) PB L 337 van 23.12.2015, blz. 1.

wijze waarop SFT-markten functioneren, zonder dat de vertrouwelijkheid van de aan transactieregisters gerapporteerde gegevens in het gedrang komt. Welke gegevens een transactieregister overeenkomstig artikel 12, lid 1, van Verordening (EU) 2015/2365 over geaggregeerde posities moet publiceren en hoe vaak, moet worden gespecificeerd op een manier die voortbouwt op het gerelateerde kader waarin Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad ([2]) voorziet voor derivatencontracten.

(8) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische reguleringsnormen die de Europese Autoriteit voor effecten en markten (European Securities and Markets Authority, ESMA) volgens de procedure van artikel 10 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad ([3]) aan de Commissie heeft voorgelegd.

(9) De bepalingen van deze verordening hebben betrekking op operationele normen voor de verzameling, aggregatie en vergelijking van gegevens door transactieregisters, alsook op de procedures die transactieregisters moeten toepassen om de volledigheid en juistheid van de aan hen gerapporteerde SFT-gegevens te verifiëren. Om de consistentie tussen deze bepalingen te waarborgen en ervoor te zorgen dat transactieregisters zich gemakkelijk een totaalbeeld van de voorschriften kunnen vormen, is het wenselijk de desbetreffende technische reguleringsnormen in één enkele verordening op te nemen.

(10) De ESMA heeft openbare raadplegingen over deze ontwerpen van technische reguleringsnormen gehouden, de mogelijke daaraan verbonden kosten en baten geanalyseerd, en de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 opgerichte ESMA-stakeholdergroep effecten en markten om advies verzocht,

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Verificatie door transactieregisters van SFT-rapportages

1. Een transactieregister verifieert alle volgende elementen van een ontvangen SFT-rapportage:

a) identiteit van de rapporterende entiteit als bedoeld in veld 2 van tabel 1 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2019/363 van de Commissie ([4]);

b) of de voor de rapportage van een SFT gebruikte XML-template in overeenstemming is met de ISO 20022-methode conform Uitvoeringsverordening (EU) 2019/363;

c) of de rapporterende entiteit, indien deze verschilt van de rapporterende tegenpartij als bedoeld in veld 3 van tabel 1 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2019/363, naar behoren gemachtigd is om namens de rapporterende tegenpartij te rapporteren, behalve in het in artikel 4, lid 3, van Verordening (EU) 2015/2365 bedoelde geval;

d) of dezelfde SFT-rapportage niet al eerder is ingediend;

e) of een SFT-rapportage met actietype „Wijziging" betrekking heeft op een eerder ingediende SFT-rapportage;

f) of een SFT-rapportage met actietype „Wijziging" geen betrekking heeft op een SFT die als geannuleerd is gerapporteerd;

g) of een SFT-rapportage niet het actietype „Nieuw" bevat en betrekking heeft op een SFT die al eerder is gerapporteerd;

h) of een SFT-rapportage niet het actietype „Positiebestanddeel" bevat en betrekking heeft op een SFT die al eerder is gerapporteerd;

([2]) Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad van 4 juli 2012 betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters (PB L 201 van 27.7.2012, blz. 1).

([3]) Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

([4]) Uitvoeringsverordening (EU) 2019/363 van de Commissie van 13 december 2018 tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen met betrekking tot het formaat en de frequentie van de rapportage over de nadere gegevens over effectenfinancieringstransacties (SFT's) aan transactieregisters overeenkomstig Verordening (EU) 2015/2365 van het Europees Parlement en de Raad en tot wijziging van Uitvoeringsverordening (EU) nr. 1247/2012 met betrekking tot het gebruik van rapportagecodes in de rapportage over derivatencontracten (zie bladzijde 85 van dit Publicatieblad).

i) of de SFT-rapportage niet beoogt de gegevens van de rapporterende entiteit, de rapporterende tegenpartij of de andere tegenpartij bij een eerder gerapporteerde SFT te wijzigen;

j) of de SFT-rapportage niet beoogt een bestaande SFT-rapportage te wijzigen door een latere valutadatum te specificeren dan de gerapporteerde vervaldatum van de SFT;

k) de juistheid en volledigheid van de SFT-rapportage.

2. Een transactieregister verifieert of in de velden 73 tot en met 96 van tabel 2 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2019/363 informatie over gestelde zekerheden is gerapporteerd voor SFT's waarvoor veld 72 „SL-markering niet door zekerheden gedekt" van diezelfde tabel als „Onwaar" is gerapporteerd. Overeenkomstig artikel 3 van deze verordening stelt het transactieregister zowel de rapporterende entiteit en de rapporterende tegenpartij als, in voorkomend geval, de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit in kennis van de uitkomst van de verificatie.

3. Een transactieregister verwerpt een SFT-rapportage die niet aan één van de vereisten van lid 1 voldoet en brengt deze rapportage onder in één van de verwerpingscategorieën die in tabel 2 van bijlage I bij deze verordening zijn vermeld.

4. Uiterlijk zestig minuten na ontvangst van een SFT-rapportage verstrekt een transactieregister zowel aan de rapporterende entiteit en de rapporterende tegenpartij als, in voorkomend geval, aan de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit gedetailleerde informatie over de resultaten van de in lid 1 bedoelde gegevensverificatie. Een transactieregister verstrekt deze resultaten in een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld. De resultaten omvatten, in voorkomend geval, de specifieke redenen voor de verwerping van een SFT-rapportage in overeenstemming met lid 3.

Artikel 2

Afstemming van gegevens door transactieregisters

1. Een transactieregister streeft de afstemming van een gerapporteerde SFT na door de in lid 2 beschreven stappen te ondernemen, mits aan alle volgende voorwaarden is voldaan:

a) het transactieregister heeft de in artikel 1, leden 1 en 2, beschreven verificaties voltooid;

b) beide tegenpartijen bij de gerapporteerde SFT hebben een rapportageverplichting;

c) het transactieregister heeft met betrekking tot de gerapporteerde SFT geen latere rapportage met actietype „Fout" ontvangen.

2. Wanneer aan alle voorwaarden van lid 1 is voldaan, onderneemt een transactieregister de volgende stappen, waarbij het gebruikmaakt van de laatst gerapporteerde waarde voor elk van de velden van tabel 1 van bijlage I bij deze verordening:

a) een transactieregister dat een SFT-rapportage heeft ontvangen, verifieert of het een overeenkomstige SFT-rapportage van of namens de andere tegenpartij heeft ontvangen;

b) een transactieregister dat geen overeenkomstige SFT-rapportage als bedoeld onder a) heeft ontvangen, tracht het transactieregister te identificeren dat de overeenkomstige SFT-rapportage heeft ontvangen door aan alle geregistreerde transactieregisters de waarden van de volgende velden van de gerapporteerde SFT mee te delen: „Unieke transactie-identificatiecode", „Rapporterende tegenpartij", „Andere tegenpartij" en „Soort raamovereenkomst";

c) een transactieregister dat vaststelt dat een ander transactieregister een overeenkomstige SFT-rapportage als bedoeld onder a) heeft ontvangen, wisselt met dat transactieregister de gegevens van de gerapporteerde SFT uit in een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld;

d) behoudens punt e) behandelt een transactieregister een gerapporteerde SFT als afgestemd wanneer de gegevens van die SFT overeenstemmen met de gegevens van de overeenkomstige SFT-rapportage als bedoeld onder a) van dit lid;

e) een transactieregister streeft de afzonderlijke matching na van de velden betreffende de leninggegevens en de velden betreffende de gegevens over gestelde zekerheden van een gerapporteerde SFT met inachtneming van de tolerantiegrenzen en de desbetreffende toepassingsdata die in tabel 1 van bijlage I bij deze verordening zijn vastgelegd;

f) vervolgens kent een transactieregister aan elke gerapporteerde SFT waarden voor de afstemmingscategorieën toe, zoals deze zijn vermeld in tabel 3 van bijlage I bij deze verordening;

g) een transactieregister voltooit zo spoedig mogelijk de onder a) tot en met f) van dit lid beschreven stappen en onderneemt op een gegeven werkdag geen van deze stappen na 18.00 uur gecoördineerde universele tijd (Universal Coordinated Time, UTC);

h) een transactieregister dat een gerapporteerde SFT niet kan afstemmen, streeft op de volgende werkdag de matching na van de gegevens van de desbetreffende gerapporteerde SFT. Het transactieregister streeft niet langer de afstemming van de gerapporteerde SFT na dertig kalenderdagen na de gerapporteerde vervaldatum van de SFT of nadat het transactieregister een op de SFT betrekking hebbende rapportage met actietype „Beëindiging" of „Positiebestanddeel" heeft ontvangen.

3. Aan het einde van elke werkdag gaat een transactieregister met elk transactieregister waarmee het gerapporteerde SFT's heeft afgestemd, na hoeveel het totaal aantal afgestemde, gerapporteerde SFT's bedraagt.

4. Uiterlijk zestig minuten na de voltooiing van het afstemmingsproces overeenkomstig lid 2, onder g), verstrekt een transactieregister zowel aan de rapporterende entiteit en de rapporterende tegenpartij als, in voorkomend geval, aan de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit de resultaten van het afstemmingsproces dat het met betrekking tot de gerapporteerde SFT's heeft uitgevoerd. Een transactieregister verstrekt deze resultaten in een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld, met vermelding van informatie over de velden die niet op elkaar zijn afgestemd.

Artikel 3

Eindedagsresponsmechanismen

Aan het einde van elke werkdag verstrekt een transactieregister zowel aan de rapporterende entiteit en de rapporterende tegenpartij als, in voorkomend geval, aan de voor de rapportage verantwoordelijke entiteit de volgende informatie over de desbetreffende SFT's in een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld:

a) in de loop van die dag gerapporteerde SFT's;

b) laatste transactiestatus van de SFT's die niet zijn vervallen of waarvoor geen rapportages met actietype „Fout", „Beëindiging" of „Positiebestanddeel" zijn ontvangen;

c) de unieke transactie-identificatiecode (UTI) van de SFT's waarvoor veld 72 van tabel 2 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2019/363 als „Onwaar" is gerapporteerd, en waarvoor in de velden 73 tot en met 96 van dezelfde tabel nog geen informatie over gestelde zekerheden is gerapporteerd;

d) de SFT-rapportages die in de loop van die dag zijn verworpen;

e) afstemmingsstatus van alle gerapporteerde SFT's, met uitzondering van de SFT's die zijn vervallen of waarvoor meer dan een maand vóór die werkdag SFT-rapportages met actietype „Beëindiging" of „Positiebestanddeel" zijn ontvangen.

Artikel 4

Toegang tot SFT-gegevens

Een transactieregister biedt de in artikel 12, lid 2, van Verordening (EU) 2015/2365 genoemde entiteiten, ook wanneer er sprake is van delegatie op grond van artikel 28 van Verordening (EU) nr. 1095/2010, rechtstreekse en onmiddellijke toegang tot de SFT-gegevens in een elektronische en machineleesbare vorm overeenkomstig Gedelegeerde verordening (EU) 2019/357 van de Commissie ([5]).

Voor de toepassing van de eerste alinea maakt een transactieregister gebruik van een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld.

([5]) Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/357 van de Commissie van 13 december 2018 tot aanvulling van Verordening (EU) 2015/2365 van het Europees Parlement en de Raad wat betreft technische reguleringsnormen betreffende toegang tot gegevens over bij transactieregisters bewaarde effectenfinancieringstransacties (SFT's) (zie bladzijde 22 van dit Publicatieblad).

Artikel 5

Berekening van en toegang tot positiegegevens

1. Een transactieregister berekent de gegevens over de posities tussen tegenpartijen wat leningen en zekerheden betreft. De berekening van positiegegevens is op de volgende criteria gebaseerd:

a) waarden voor de afstemmingscategorieën, zoals vermeld in tabel 3 van bijlage I bij deze verordening;

b) soort SFT;

c) sector van de tegenpartijen;

d) clearingstatus;

e) wel of niet op een handelsplatform;

f) soort zekerheden;

g) valuta van de geldzijde;

h) looptijdsegment;

i) haircutcategorie;

j) transactieregisters waaraan de andere tegenpartij SFT-gegevens heeft gerapporteerd.

2. Een transactieregister zorgt ervoor dat de in artikel 12, lid 2, van Verordening (EU) 2015/2365 genoemde entiteiten toegang hebben tot positiegegevens in overeenstemming met de gegevenstoegang die is gespecificeerd in Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/357.

3. De in lid 1 bedoelde positiegegevens worden verstrekt in een elektronische en machineleesbare vorm en met gebruikmaking van een template in XML-formaat die overeenkomstig de ISO 20022-methode is ontwikkeld.

4. De in lid 2 bedoelde toegang wordt zo spoedig mogelijk geboden en uiterlijk op de werkdag na ontvangst van een SFT-rapportage overeenkomstig artikel 4, lid 1, van Verordening (EU) 2015/2365.

5. Een transactieregister biedt de in artikel 12, lid 2, van Verordening (EU) 2015/2365 genoemde entiteiten toegang tot geaggregeerde gegevens in overeenstemming met de gegevenstoegang die is gespecificeerd Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/357; deze gegevens zijn berekend volgens gezamenlijk overeengekomen normen en procedures voor de wereldwijde verzameling en aggregatie van SFT-gegevens.

Artikel 6

Berekening van gegevens over geaggregeerde posities voor publicatie

1. Een transactieregister gaat met inachtneming van de criteria van de leden 2 en 3 over tot de aggregatie van positiegegevens met betrekking tot de volgende waarden:

a) de hoofdsom van repo-overeenkomsten en van koop/wederverkoop- of verkoop/terugkooptransacties, de totale hoeveelheid effecten of grondstoffen die worden uitgeleend of ingeleend, en het bedrag aan margeleningen;

b) het aantal UTI's die op de desbetreffende SFT's betrekking hebben;

c) de marktwaarde van de zekerheden.

2. Een transactieregister gaat tussen zaterdag 00:00:00 UTC en vrijdag 23:59:59 UTC over tot de aggregatie van positiegegevens voor alle met actietype „Nieuw" gerapporteerde SFT's op basis van de volgende criteria en de gerelateerde waarden die in tabel 1 van bijlage II bij deze verordening zijn vastgesteld:

a) locatie van de rapporterende tegenpartij of, in voorkomend geval, van het betrokken bijkantoor;

b) locatie van de andere tegenpartij of, in voorkomend geval, van het betrokken bijkantoor;

c) soort SFT;

d) afstemmingsstatus van de SFT, zoals vastgelegd in tabel 3 van bijlage I bij deze verordening;

e) soort platform waarop de SFT is gesloten;

f) of de SFT al dan niet is gecleard;

g) gevolgde methode voor de overdracht van de zekerheden;

h) elke index die als referentie bij een SFT is gebruikt en die op een andere plaats van uitvoering dan „XXXX" wordt verhandeld, ingeval het aan het transactieregister in de index gerapporteerde nominale totaalbedrag groter is dan 5 miljard EUR en ingeval er ten minste zes verschillende tegenpartijen zijn die de desbetreffende SFT's aan het transactieregister hebben gerapporteerd.

3. Een transactieregister gaat uiterlijk vrijdag 23:59:59 UTC over tot de aggregatie van positiegegevens voor alle SFT's die niet vervallen zijn of waarvoor geen rapportages met actietype „Fout", „Beëindiging" of „Positiebestanddeel" zijn ontvangen, op basis van de volgende criteria en de gerelateerde waarden die in tabel 1 van bijlage II bij deze verordening zijn vastgesteld:

a) locatie van de rapporterende tegenpartij of, in voorkomend geval, van het betrokken bijkantoor;

b) locatie van de andere tegenpartij of, in voorkomend geval, van het betrokken bijkantoor;

c) soort SFT;

d) afstemmingsstatus van de SFT, zoals vastgelegd in tabel 3 van bijlage I bij deze verordening;

e) soort platform waarop de SFT is gesloten;

f) of de SFT al dan niet is gecleard;

g) gevolgde methode voor de overdracht van de zekerheden;

h) elke index die als referentie bij een SFT is gebruikt en die op een andere plaats van uitvoering dan „XXXX" wordt verhandeld, ingeval het aan het transactieregister in de index gerapporteerde nominale totaalbedrag groter is dan 5 miljard EUR en ingeval er ten minste zes verschillende tegenpartijen zijn die de desbetreffende SFT's aan het transactieregister hebben gerapporteerd.

4. Een transactieregister beschikt over een procedure om buitengewone waarden met betrekking tot gegevens over geaggregeerde posities te detecteren.

5. Een transactieregister beschikt over een procedure om correcties van de gegevens over geaggregeerde posities, zoals onder meer die welke uit rapportages met actietype „Fout" voortvloeien, uit te voeren en te melden, en om de oorspronkelijke en gecorrigeerde gegevensaggregaties te publiceren.

Artikel 7

Publicatie van gegevens over geaggregeerde posities

1. Een transactieregister publiceert wekelijks, en uiterlijk op dinsdagmiddag, op zijn website overeenkomstig artikel 6 berekende gegevens over geaggregeerde posities voor SFT's die vóór 23:59:59 UTC van de voorgaande vrijdag zijn gerapporteerd.

2. Een transactieregister publiceert alle gegevens over geaggregeerde posities in euro en maakt daarbij gebruik van de wisselkoersen die zijn gepubliceerd op de ECB-website op de vrijdag die aan de publicatie van deze gegevens voorafgaat.

3. Een transactieregister zorgt ervoor dat de gegevens over geaggregeerde posities worden gepubliceerd in de tabelvorm die in bijlage II bij deze verordening is vastgelegd en die het downloaden van de gegevens mogelijk maakt.

4. De door een transactieregister op zijn website gepubliceerde gegevens over geaggregeerde posities blijven gedurende ten minste 104 weken op die website staan.

Artikel 8

Inwerkingtreding

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 13 december 2018.

Voor de Commissie

De voorzitter

Jean-Claude JUNCKER

BIJLAGE I

Tabel 1

Afstemmingsvelden, tolerantieniveaus en aanvangsdatum van de afstemmingsfase

Tabel	Sectie	Veld	Tolerantie	Aanvangsdatum genoemd in:
Tegenpartijgegevens	N.v.t.	Rapporterende tegenpartij	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Tegenpartijgegevens	N.v.t.	Zijde van de tegenpartij	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Tegenpartijgegevens	N.v.t.	Andere tegenpartij	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Unieke transactie-identificatiecode (UTI)	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Soort SFT	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Gecleard	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Tijdstempel van de clearing	1 uur	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Centrale tegenpartij	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Handelsplatform	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Soort raamovereenkomst	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Tijdstempel van de uitvoering	1 uur	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Valutadatum (begindatum)	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Vervaldatum (einddatum)	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Beëindigingsdatum	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Minimale opzegtermijn	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Vroegste call-backdatum	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Algemene zekerhedenindicator	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden

Tabel	Sectie	Veld	Tolerantie	Aanvangsdatum genoemd in:
Transactiegegevens	Lening	DBV-indicator (Delivery By Value)	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Gebruikte methode voor het verschaffen van zekerheden	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Open termijn	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Mogelijkheid tot beëindiging	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Vaste rente	Tot derde cijfer na decimaal	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Dagtellingsconventie	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Variabele rente	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Referentieperiode variabele rente — periode	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Referentieperiode variabele rente — multiplicator	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Betalingsfrequentie variabele rente — periode	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Betalingsfrequentie variabele rente — multiplicator	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Herzieningsfrequentie variabele rente — periode	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Herzieningsfrequentie variabele rente — multiplicator	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Spread	Tot derde cijfer na decimaal	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Bedrag in margeleningsvaluta	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Margeleningsvaluta	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365

Tabel	Sectie	Veld	Tolerantie	Aanvangsdatum genoemd in:
Transactiegegevens	Lening	Aangepaste rente	Tot derde cijfer na decimaal	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Rentedatum	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Hoofdsom op de valutadatum	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Hoofdsom op de vervaldatum	0,0005 %	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Valuta hoofdsom	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Soort activa	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Effectenidentificatiecode	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Classificatie van een effect	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Basisproduct	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Subproduct	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Verder subproduct	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Hoeveelheid of nominaal bedrag	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Meeteenheid	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Valuta van nominaal bedrag	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Effect- of grondstoffenprijs	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Prijsvaluta	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Kwaliteit van het effect	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Looptijd van het effect	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365

Tabel	Sectie	Veld	Tolerantie	Aanvangsdatum genoemd in:
Transactiegegevens	Lening	Rechtsgebied van de emittent	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	LEI van de emittent	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Effectentype	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Waarde lening	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Marktwaarde	0,0005 %	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Vast kortingspercentage	Tot derde cijfer na decimaal	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Variabel kortingspercentage	Tot derde cijfer na decimaal	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Referentieperiode variabel kortingspercentage — periode	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Referentieperiode variabel kortingspercentage — multiplicator	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Betalingsfrequentie variabel kortingspercentage — periode	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Betalingsfrequentie variabel kortingspercentage — multiplicator	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Herzieningsfrequentie variabel kortingspercentage — periode	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Herzieningsfrequentie variabel kortingspercentage — multiplicator	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Spread van het kortingspercentage	Tot derde cijfer na decimaal	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Leningvergoeding	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365

Tabel	Sectie	Veld	Tolerantie	Aanvangsdatum genoemd in:
Transactiegegevens	Lening	Exclusieve regelingen	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Lening	Uitstaande margelening	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Basisvaluta van uitstaande margelening	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Shortmarktwaarde	0,0005 %	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Markering dat het een niet door zekerheden gedekte effectenlening betreft (SL-markering)	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Zekerheidsstelling van nettopositie	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Valutadatum van de zekerheden	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Soort zekerhedencomponent	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Bedrag aan zekerheden in de vorm van contanten	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Valuta van zekerheden in de vorm van contanten	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Identificatie van een als zekerheid gebruikt effect	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Classificatie van een als zekerheid gebruikt effect	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Basisproduct	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Zekerheden	Subproduct	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Zekerheden	Verder subproduct	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), iv), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Zekerheden	Hoeveelheid zekerheden of nominaal bedrag aan zekerheden	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Meeteenheid zekerheden	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden

Tabel	Sectie	Veld	Tolerantie	Aanvangsdatum genoemd in:
Transactiegegevens	Zekerheden	Valuta van nominaal bedrag aan zekerheden	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Prijsvaluta	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Zekerheden	Prijs per eenheid	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Zekerheden	Marktwaarde zekerheden	0,0005 %	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365 + 24 maanden
Transactiegegevens	Zekerheden	Haircut of marge	Tot derde cijfer na decimaal	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Kwaliteit zekerheden	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Vervaldatum van het effect	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Rechtsgebied van de emittent	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	LEI van de emittent	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Type zekerheid	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Beschikbaarheid voor hergebruik als zekerheid	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Zekerheden	Identificatiecode zekerhedenpakket	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365
Transactiegegevens	Lening	Niveau	Neen	Artikel 33, lid 2, onder a), i), van Verordening (EU) 2015/2365

Tabel 2

Redenen voor de verwerping van een SFT-rapportage

Verwerpingscategorieën	Reden
Schema	— de SFT is verworpen omdat het schema niet conform is
Machtiging	— de SFT is verworpen omdat de rapporterende entiteit niet gemachtigd is om namens de rapporterende tegenpartij te rapporteren
Logica	— de SFT is verworpen omdat het actietype voor de SFT niet logisch juist is
Bedrijfsactiviteit	— de SFT is verworpen omdat de SFT niet aan een of meer inhoudvalidaties voldoet

Tabel 3

Resultaten van het afstemmingsproces

Afstemmingscategorieën	Afstemmingswaarden
Soort rapportage	Eenzijdig/Tweezijdig
Rapportagevereiste geldt voor beide tegenpartijen	Ja/Neen
Koppelingsstatus	Gekoppeld/Niet gekoppeld
Afstemmingsstatus lening	Afgestemd/Niet afgestemd
Afstemmingsstatus zekerheden	Afgestemd/Niet afgestemd
Verdere wijzigingen	Ja/Neen

BIJLAGE II

Tabel 1

Publieke gegevens

Tabel A. Aggregatie

Datum	TR	Type aggregatie	Soort platform	Locatie van rapporterende tegenpartij	Locatie van andere tegenpartij	Afstemming	Soort SFT	Gecleard	Methode voor overdracht zekerheden	Als referentie gebruikte index [1]	Totaal uitgeleend bedrag	Totaal aantal transacties	Totale waarde van de zekerheden
20161007	EU TR	Gerapporteerd	XXXX	EER	EER	Tweezijdig, lening afgestemd, zekerheden niet afgestemd	Repo	Ja	TTCA		…		…
…	…	Nog te ontvangen	XOFF	Niet-EER	Niet-EER	Tweezijdig, lening afgestemd, zekerheden afgestemd	BSB/SBB	Neen	SICA		…		…
…	…	…	EER-MIC	…	…	Eenzijdig EER, lening afgestemd, zekerheden afgestemd	Uitlening en inlening van effecten of grondstoffen	…	SIUR		…		…
…	…	…	Niet-EER-MIC	…	…	…	Margelening	…			…		…
…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…	…

[1] De desbetreffende indexen invullen die zijn opgenomen in veld 25 van tabel 2 „Gegevens over leningen en zekerheden” van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2019/363.