



Rådet for
Den Europæiske Union

Bruxelles, den 17. juni 2022
(OR. en)

10387/22
ADD 1

EF 179
ECOFIN 638
DELECT 98

FØLGESKRIVELSE

fra:	Martine DEPREZ, direktør, på vegne af generalsekretæren for Europa-Kommissionen
til:	Generalsekretariatet for Rådet
Komm. dok. nr.:	C(2022) 3589 final
Vedr.:	BILAG til KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) .../... om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder om præcisering af de oplysninger, der som minimum skal indberettes til transaktionsregistre, og den type indberetninger, der skal anvendes

Hermed følger til delegationerne dokument C(2022) 3589 final.

Bilag: C(2022) 3589 final



EUROPA-
KOMMISSIONEN

Bruxelles, den 10.6.2022
C(2022) 3589 final

ANNEX

BILAG

til

KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) .../...

**om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012
for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder om præcisering af de
oplysninger, der som minimum skal indberettes til transaktionsregistre, og den type
indberetninger, der skal anvendes**

BILAG

Tabel 1

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
1	Derivatets parter	Tidsstempel for indberetningen	Dato og klokkeslæt for indberetningen til transaktionsregistret.
2	Derivatets parter	ID for indberettende enhed	Hvis enheden med ansvar for indberetningen har delegeret indgivelsen af indberetningen til en tredjepart eller til den anden modpart, skal der for den pågældende enhed i dette felt anføres en entydig identifikationskode. Ellers skal enheden med ansvar for indberetningen identificeres i dette felt.
3	Derivatets parter	Enhed med ansvar for indberetningen	Hvis en finansiel modpart er eneansvarlig og er juridisk ansvarlig for indberetning på vegne af begge modparter i overensstemmelse med artikel 9, stk. 1a, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 ¹ , og den ikke-finansielle modpart ikke selv beslutter at indberette oplysninger om sine OTC-derivataftaler med den finansielle modpart, angives den entydige identifikationskode for denne finansielle modpart. Hvis et administrationsselskab er ansvarligt og juridisk ansvarligt for indberetningen på vegne af et institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) i henhold til artikel 9, stk. 1b), i nævnte forordning, angives den entydige identifikationskode for det pågældende administrationsselskab. Hvis en forvalter af alternative investeringsfonde (FAIF'er) er ansvarlig og juridisk ansvarlig for indberetningen på vegne af en alternativ investeringsfond (AIF) i henhold til artikel 9, stk. 1c), i den pågældende forordning, den entydige identifikationskode for denne FAIF.

¹ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre (EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1).

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			Hvis en godkendt enhed, der er ansvarlig for forvaltningen og handler på vegne af en IORP, er ansvarlig og juridisk ansvarlig for indberetning på dens vegne i overensstemmelse med artikel 9, stk. 1d), i nævnte forordning, den unikke kode til identifikation af denne enhed. Dette felt gælder kun for OTC-derivater.
4	Derivatets parter	Modpart 1 (Indberettende modpart)	Identifikator for modparten i en derivattransaktion, som opfylder sin indberetningspligt gennem den pågældende indberetning. Ved en allokeret derivattransaktion, der gennemføres af en fondsforvalter på vegne af en fond, indberettes fonden og ikke fondsforvalteren som modpart.
5	Derivatets parter	Arten af modpart 1	Angiv, om modpart 1 er en central modpart ("CCP"), en finansiell modpart eller en ikke-finansiell modpart som defineret i artikel 2, nr. 1), 8) og 9), i forordning (EU) nr. 648/2012, eller en enhed som omhandlet i artikel 1, nr. 5), i nævnte forordning.
6	Derivatets parter	Virksomhedssektor for modpart 1	Virksomhedsaktiviteter for modpart 1. Hvis modpart 1 er en finansiell modpart, skal dette felt indeholde alle de nødvendige koder, der indgår i klassificeringssystemet for finansielle modparter i felt 6 i tabel 1 i bilaget til [Publikationskontoret: <i>Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588</i>], og som finder anvendelse på den pågældende modpart. Hvis modpart 1 er en ikke-finansiell modpart, skal dette felt indeholde alle de nødvendige koder, der indgår i klassificeringssystemet for ikke-finansielle modparter i felt 6 i tabel 1 i bilaget til [Publikationskontoret: <i>Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588</i>], og som finder anvendelse på den pågældende modpart. Hvis der indberettes mere end en enkelt

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			aktivitet, angives koderne efter de tilsvarende aktiviteter relative betydning.
7	Derivatets parter	Clearinggrænseværdi for modpart 1	Oplysninger om, hvorvidt modpart 1 ligger over clearinggrænseværdien, jf. artikel 4a, stk. 3 eller artikel 10 stk. 3, i forordning (EU) nr. 648/2012 på tidspunktet for indgåelsen af transaktionen.
8	Derivatets parter	Type identifikator for modpart 2	Indikator for, hvorvidt LEI-koden blev anvendt til at identificere modpart 2.
9	Derivatets parter	Modpart 2	Identifikator for den anden modpart i en derivattransaktion. Ved en allokeret derivattransaktion, der gennemføres af en fondsforvalter på vegne af en fond, indberettes fonden og ikke fondsforvalteren som modpart.
10	Derivatets parter	Det pågældende land for modpart 2	Såfremt modpart 2 er en fysisk person, koden for den pågældende persons bopælsland.
11	Derivatets parter	Arten af modpart 2	Angiv, om modpart 2 er en central modpart ("CCP"), en finansiel modpart eller en ikke-finansiel modpart som defineret i artikel 2, nr. 1), 8) og 9), i forordning (EU) nr. 648/2012, eller en enhed som omhandlet i artikel 1, nr. 5), i nævnte forordning.
12	Derivatets	Virksomhedssektor for	Virksomhedsaktiviteter for modpart 2. Hvis modpart 2 er en finansiel modpart,

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
	parter	modpart 2	<p>skal dette felt indeholde alle de nødvendige koder, der indgår i klassificeringssystemet for finansielle modparter i felt 6 i tabel 1 i bilaget til [Publikationskontoret: <i>Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588</i>], og som finder anvendelse på den pågældende modpart.</p> <p>Hvis modpart 2 er en ikke-finansiell modpart, skal dette felt indeholde alle de nødvendige koder, der indgår i klassificeringssystemet for ikke-finansielle modparter i felt 6 i tabel 1 i bilaget til [Publikationskontoret: <i>Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588</i>], og som finder anvendelse på den pågældende modpart.</p> <p>Hvis der indberettes mere end en enkelt aktivitet, angives koderne efter de tilsvarende aktiviteter relative betydning.</p>
13	Derivatets parter	Clearinggrænseværdi for modpart 2	Oplysninger om, hvorvidt modpart 2 ligger over clearinggrænseværdien, jf. artikel 4a, stk. 3 eller artikel 10 stk. 3, i forordning (EU) nr. 648/2012 på tidspunktet for indgåelsen af transaktionen.
14	Derivatets parter	Indberetningsforpligtelse for modpart 2	Indikator for, hvorvidt modpart 2 har indberetningspligt i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012, uanset hvem der har ansvaret og er juridisk ansvarlig for indberetningen.
15	Derivatets parter	Mægler-ID	Hvis en mægler fungerer som formidler for modpart 1 uden selv at være en modpart, skal modpart 1 anføre en entydig identifikationskode for denne mægler.
16	Derivatets parter	Clearingmedlem	Identifikator for det clearingmedlem, gennem hvilket en derivattransaktion blev cleared hos en CCP. Dette dataelement gælder for cleared transaktioner.
17	Derivatets parter	Retning	Indikator for, hvorvidt modpart 1 er køber eller sælger som fastsat på den

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			dato, hvor derivatet blev indgået.
18	Derivatets parter	Retning af første ben	Indikator for, hvorvidt modpart 1 betaler for eller modtager første ben som fastsat på den dato, hvor derivatet blev indgået.
19	Derivatets parter	Retning af andet ben	Indikator for, hvorvidt modpart 1 betaler for eller modtager andet ben som fastsat på den dato, hvor derivatet blev indgået.
20	Derivatets parter	Direkte tilknyttet forretningsmæssige aktiviteter eller likviditetsfinansiering	Oplysninger om, hvorvidt aftalen objektivt kan måles som værende direkte knyttet til den indberettende modpart 1's forretningsmæssige aktivitet eller likviditetsfinansiering, jf. artikel 10, stk. 3, i forordning (EU) nr. 648/2012. Dette felt udfyldes kun, hvis modpart 1 er en ikke-finansiell modpart som defineret i artikel 2, nr. 9), i forordning (EU) nr. 648/2012.

Tabel 2

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
1	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	UTI (unik handelsidentifikator)	Unik handelsidentifikator som omhandlet i artikel 7 i <i>[Publikationskontoret: Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588]</i> .
2	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	Indberetningens referencenummer	Hvis et derivat blev udført på en markedsplads, anføres et nummer, der er genereret af markedspladsen, og som er

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			unikt for denne udførelse.
3	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	Forudgående UTI (for forbindelserne én-til-én og én-til-mange mellem transaktioner)	UTI tildelt den forudgående transaktion, der har givet anledning til den indberettede transaktion som følge af en livscyklushændelse, i en én-til-én-forbindelse mellem transaktioner (f.eks. i tilfælde af nyordning, når en transaktion afvikles, og der genereres en ny transaktion) eller i en én-til-mange-forbindelse mellem transaktioner (f.eks. i forbindelse med clearing, eller hvis en transaktion er opdelt i flere forskellige transaktioner). Dette dataelement er ikke relevant, når der rapporteres mange-til-én og mange-til-mange-forbindelser mellem transaktioner (f.eks. i tilfælde af komprimering).
4	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	UTI for efterfølgende position	UTI for den position, hvori et afledt finansielt instrument indgår. Dette felt er kun relevant for indberetninger vedrørende afvikling af et derivat, som følge af dets medtagelse i en position.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
5	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	ID for efterhandelstjenesteydelse r til risikoreduktion (PTRR)	Identifikator genereret af PTRR-tjenesteudbyderen eller den CCP, der leverer PTRR-tjenesteydelsen, med henblik på at sammenkæde alle derivater, der indgår i en given PTRR-hændelse, og som følger af den pågældende PTRR- hændelse.
6	Afdeling 2a — Identifikatorer og link	Identifikator for pakken	Identifikator (fastsat af modpart 1) med henblik på at sammenkæde derivater i samme pakke i overensstemmelse med artikel 1, stk. 3, tredje afsnit, i denne forordning. En pakke kan omfatte indberetningspligtige og ikke indberetningspligtige transaktioner.
7	Afdeling 2b — Aftaledata	Internationalt identifikationsnummer for værdipapirer (ISIN- nummer)	ISIN til identifikation af produktet, hvis det pågældende produkt er optaget til handel eller handles på et reguleret marked, en MHF (multilateral handelsfacilitet), en OHF (organiseret handelsfacilitet) eller en systematisk internalisator.
8	Afdeling 2b — Aftaledata	Entydig produktidentifikator (UPI)	UPI til identifikation af produktet.
9	Afdeling 2b — Aftaledata	Produktklassifikation	Kode til klassifikation af finansielle instrumenter (CFI) vedrørende det pågældende instrument.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
10	Afdeling 2b — Aftaledata	Aftaletype	Alle indberettede aftaler skal klassificeres efter type.
11	Afdeling 2b — Aftaledata	Aktivklasse	Alle indberettede aftaler skal klassificeres efter den aktivklasse, de er baseret på.
12	Afdeling 2b — Aftaledata	Derivat baseret på kryptoaktiver	Indikator for, om derivatet er baseret på kryptoaktiver.
13	Afdeling 2b — Aftaledata	Type identifikation af det underliggende aktiv	Type relevant identifikator for underliggende aktiv.
14	Afdeling 2b — Aftaledata	Identifikation af det underliggende aktiv	Det direkte underliggende aktiv identificeres ved hjælp af en entydig identifikator for dette underliggende aktiv baseret på type. For credit default swaps angives referenceforpligtelsens ISIN-kode.
15	Afdeling 2b — Aftaledata	Indikator for det underliggende indeks	I givet fald en angivelse af det underliggende indeks.
16	Afdeling 2b — Aftaledata	Navnet på det underliggende indeks	Det fulde navn på det underliggende indeks, der er tildelt af indeksleverandøren.
17	Afdeling 2b — Aftaledata	Kode for kundespecifik kurv	Hvis derivattransaktionen er baseret på en kundespecifik kurv, en unik kode, der er tildelt af den enhed, der har sammensat den kundespecifikke kurv for at forbinde dens komponenter.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
18	Afdeling 2b — Aftaledata	Identifikator for kurvens komponenter	Hvis der er tale om en kundespecifik kurv sammensat af bl.a. finansielle instrumenter, som handles på en markedsplads, angives udelukkende finansielle instrumenter, som handles på en markedsplads.
19	Afdeling 2b — Aftaledata	Afviklingsvaluta 1	Valuta for kontantafvikling af transaktionen, hvis det er relevant. For produkter i flere valutaer, der ikke udlignes, afviklingsvalutaen for det første ben. Dette dataelement er ikke relevant for fysisk afviklede produkter (f.eks. fysisk afviklede swaptioner).
20	Afdeling 2b — Aftaledata	Afviklingsvaluta 2	Valuta for kontantafvikling af transaktionen, hvis det er relevant. For produkter i flere valutaer, der ikke udlignes, afviklingsvalutaen for det andet ben. Dette dataelement er ikke relevant for fysisk afviklede produkter (f.eks. fysisk afviklede swaptioner).
21	Afdeling 2c — Vurdering	Vurderingssum	Vurdering af opgørelse til markedsværdi af aftalen eller vurdering af opgørelse til modelværdi, jf. artikel 4 i denne forordning. CCP'ens vurdering skal anvendes for en cleared transaktion.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
22	Afdeling 2c — Vurdering	Vurderingsvaluta	Valuta, i hvilken vurderingssummen er denomineret.
23	Afdeling 2c — Vurdering	Tidsstempel for vurdering	Dato og klokkeslæt for den seneste vurdering, der er opgjort til markedsværdi, leveret af CCP'en eller beregnet ved hjælp af den aktuelle eller seneste tilgængelige markedspris for input.
24	Afdeling 2c — Vurdering	Vurderingsmetode	Kilde og metode anvendt til vurdering af transaktionen foretaget af modpart 1. Hvis der anvendes mindst ét vurderingsinput, der klassificeres som opgørelse til modelværdi, klassificeres hele vurderingen som opgørelse til modelværdi. Hvis der kun anvendes input, der klassificeres som opgørelse til markedsværdi, klassificeres hele vurderingen som opgørelse til markedsværdi.
25	Afdeling 2c — Vurdering	Delta	Forholdet mellem ændringen i prisen på en derivattransaktion og ændringen i prisen på det underliggende aktiv. Dette felt gælder kun for optioner og swaptioner. Ajourførte oplysninger om delta indberettes dagligt af finansielle modparter og ikke-finansielle modparter, jf. artikel 10, i forordning (EU) nr. 648/2012.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
26	Afdeling 2d — Sikkerhedsstillelse	Indikator for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Indikator for, hvorvidt sikkerhedsstillelsen blev stillet på porteføljebasis. Ved "på porteføljebasis" forstås et sæt transaktioner, der er forbundet med marginer (enten på netto- eller bruttobasis) i modsætning til det scenarie, hvor marginen beregnes og stilles særskilt for hver enkelt transaktion.
27	Afdeling 2d — Sikkerhedsstillelse	Kode for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Hvis sikkerhedsstillelsen indberettes på porteføljebasis, en entydig kode tildelt af modpart 1 til porteføljen. Dette dataelement er ikke relevant, hvis sikkerhedsstillelsen blev udført på transaktionsniveau, eller hvis der ikke foreligger en aftale om sikkerhedsstillelse, eller hvis der ikke stilles eller modtages sikkerhed.
28	Afdeling 2e — Risikoreduktion/indberetning	Tidsstempel for bekræftelse	Dato og klokkeslæt for bekræftelsen, jf. artikel 12 i Kommissionens delegerede forordning (EU) nr. 149/2013 ² . Gælder kun OTC-derivataftaler, der ikke cleares af en CCP.

² Kommissionens delegerede forordning (EU) nr. 149/2013 af 19. december 2012 om udbygning af Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for indirekte clearingordninger, clearingforpligtelsen, det offentlige register, adgang til en handelsplads, ikke-finansielle modparter og risikoreduktionsteknikker for OTC-derivataftaler, der ikke cleares af en CCP (EUT L 052 af 23.2.2013, s. 11).

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
29	Afdeling 2e — Risikoreduktion/indberetning	Bekræftet	<p>For nye indberetningspligtige transaktioner, hvorvidt de retligt bindende vilkår i en OTC-derivataftale blev dokumenteret og aftalt (bekræftet) eller ej (ikke bekræftet).</p> <p>Hvis det er dokumenteret og aftalt, hvorvidt en sådan bekræftelse er foretaget:</p> <ul style="list-style-type: none"> • via en fælles bekræftelsesfacilitet eller -platform eller et privat eller bilateralt elektronisk system (elektronisk) • via et menneskeligt læsbart dokument, f.eks. fax, papir eller manuelt behandlede e-mails (ikke-elektroniske). <p>Gælder kun OTC-derivataftaler, der ikke cleares af en CCP.</p>
30	Afdeling 2f — Clearing	Clearingforpligtelse	<p>Angivelse af, hvorvidt den indberettede aftale er knyttet til en OTC-derivatklasse, som er erklæret omfattet af indberetningsforpligtelsen, og begge modparter i aftalen er omfattet af clearingforpligtelsen i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012, at regne fra aftalens gennemførelse.</p> <p>Finder kun anvendelse på OTC-derivataftaler.</p>
31	Afdeling 2f — Clearing	Clearet	<p>Indikator for, om derivatet er blevet clearet af en CCP.</p>

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
32	Afdeling 2f — Clearing	Tidsstempel for clearing	Klokkeslæt og dato for clearing. Gælder kun OTC-derivataftaler, der cleares af en CCP.
33	Afdeling 2f — Clearing	Central modpart	Identifikator for den CCP, der clearede transaktionen. Dette dataelement er ikke relevant, hvis værdien af dataelementet "Cleared" er "N" ("Nej, ikke cleared centralt").
34	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Masteraftaletype	Henvisning til type masteraftale, i henhold til hvilken modparterne indgik et derivat.
35	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Andre typer masteraftaler	Navnet på masteraftalen Dette felt udfyldes kun, hvis der i felt 34 i denne tabel står "OTHR".
36	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Masteraftaleversion	Angivelse af året for den masteraftale, der i givet fald er anvendt ved den indberettede transaktion.
37	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Koncernintern	Angivelse af, hvorvidt aftalen er indgået i form af en koncernintern transaktion, jf. artikel 3 i forordning (EU) nr. 648/2012.
38	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	PTRR	Angiv, om kontrakten er resultatet af en PTRR-transaktion.
39	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Type af PTRR-teknik	Indikator for en type PTRR-transaktion med henblik på indberetning i henhold til forordning (EU) nr. 648/2012. Porteføljekomprimering

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<p>uden en tredjepartstjenesteudbyder: En ordning for at reducere risikoen i eksisterende handelsporteføljer, hvor der anvendes ikkeprisdannende handler, hovedsagelig for at reducere det nominelle udestående beløb, antallet af transaktioner eller på anden måde harmonisere vilkårene ved helt eller delvist at afvikle handler og normalt erstatte de afviklede derivater med nye genanskaffelseshandler. Porteføljekomprimering med en tredjepartstjenesteudbyder eller en CCP: En PTRR-tjenesteydelse, der leveres af en tjenesteudbyder eller en CCP for at reducere risikoen i eksisterende handelsporteføljer, hvor der anvendes ikkeprisdannende handler, hovedsagelig for at reducere det nominelle udestående beløb, antallet af transaktioner eller på anden måde harmonisere vilkårene ved helt eller delvist at afvikle handler og generelt erstatte de afviklede derivater med nye genanskaffelseshandler. Genskabelse af porteføljebalancer/forvaltning af marginer: En PTRR-tjenesteydelse, der leveres af en tjenesteudbyder for at reducere risikoen i en eksisterende portefølje af handler ved at tilføje nye</p>

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			ikke-prisdannende handler, og hvor ingen eksisterende handler i porteføljen afvikles eller erstattes, og den fiktive værdi øges i stedet for at falde. PTRR-tjenesteydelser for andre porteføljer: En PTRR-tjenesteydelse, der leveres af en tjenesteudbyder for at reducere risikoen i eksisterende handelsporteføljer ved hjælp af handler, der ikke er prisdannende, og hvor en sådan tjenesteydelse ikke betragtes som porteføljekomprimering eller genskabelse af porteføljebalancer.
40	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	PTRR-tjenesteudbyder	LEI-kode til identifikation af PTRR-tjenesteudbyderen.
41	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Handelssted	Angivelse af det handelssted, hvor transaktionen blev gennemført. Brug den segmentspecifikke MIC (ISO 10383) for transaktioner gennemført på en markedsplads, en systematisk internalisator (SI) eller en organiseret handelsplatform uden for Unionen. Hvis der ikke findes en segmentspecifik MIC, anvendes den operationelle MIC. Brug MIC-koden "XOFF" for finansielle instrumenter, der er optaget til handel eller handles på en markedsplads, eller for

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<p>hvilke der er indgivet en anmodning om optagelse, hvis transaktionen i det pågældende finansielle instrument ikke gennemføres på en markedsplads, en SI eller en organiseret handelsplatform uden for Unionen, eller hvis en modpart ikke er klar over, at den handler med en modpart 2, der fungerer som en SI.</p> <p>Anvend MIC-kode "XXXX" for finansielle instrumenter, der ikke er godkendt til handel eller ikke handles på en markedsplads, eller for hvilke der ikke er indgivet anmodning om optagelse til handel, og som ikke handles på en organiseret markedsplads uden for Unionen.</p>
42	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Tidsstempel for gennemførelse	<p>Dato og tidspunkt for, hvornår en transaktion oprindeligt blev gennemført og resulterede i generering af en ny UTI. Dette dataelement forbliver uændret i hele dette UTI's levetid. For indberetning af positionsniveau bør der henvises til det tidspunkt, da positionen blev åbnet for første gang.</p>

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
43	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato	Ikke-reguleret dato, hvor forpligtelserne i henhold til OTC-derivattransaktionen træder i kraft, som angivet i bekræftelsen. Hvis ikrafttrædelsesdatoen ikke er angivet som en del af vilkårene for aftalen, skal modparterne i dette felt indberette datoen for gennemførelsen af derivatet.
44	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Udløbsdato	Ikke-reguleret dato, hvor forpligtelserne i henhold til derivattransaktionen ophører med at være gældende, som angivet i bekræftelsen. Førtidig afvikling påvirker ikke dette dataelement.
45	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Dato for førtidig afvikling	Ikrafttrædelsesdatoen for den indberettede transaktions førtidige afvikling (udløb). Dette dataelement finder anvendelse, hvis transaktionen afvikles før dens udløb som følge af en modparts (eller modparters) tidligere midlertidige afgørelse.
46	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Endelig kontraktlig afviklingsdato	Ikke-reguleret dato i henhold til aftalen, inden for hvilken al overførsel af kontanter eller aktiver bør finde sted, og hvor modparterne ikke længere bør have udestående forpligtelser over for hinanden i henhold til den pågældende aftale. For produkter, som måske ikke har en endelig kontraktlig afviklingsdato

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			(f.eks. amerikanske optioner), afspejler dette dataelement den dato, på hvilken overførslen af kontanter eller aktiver ville finde sted, hvis afviklingen fandt sted på udløbsdatoen.
47	Afdeling 2c — Nærmere oplysninger om transaktionen	Afviklingsmåde	Angiver, hvorvidt aftalen afvikles fysisk eller kontant.
48	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Pris	Pris angivet i derivattransaktionen. Den omfatter ikke gebyrer, afgifter og provisioner. Hvis prisen er ukendt, når en ny transaktion indberettes, ajourføres prisen, efterhånden som den foreligger. For transaktioner, der indgår i en pakke, indeholder dette dataelement prisen på den enkelte komponent i transaktionen, hvor det er relevant.
49	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Prisvaluta	Valuta, i hvilken prisen er denomineret. Prisvaluta anvendes kun, hvis prisen udtrykkes som en pengeværdi.
	Felt 50 til 52 gentages og skal udfyldes, hvis der er tale om derivater, der omfatter prisoversigter.		
50	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikke-reguleret ikrafttrædelsesdato for prisen	Ikke-reguleret ikrafttrædelsesdato for prisen.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
51	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikke-reguleret slutdato for prisen	Ikke-reguleret slutdato for prisen (ikke relevant, hvis den ikke-regulerede slutdato for en given tidsperiode ligger i forlængelse af den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato for den efterfølgende periode).
52	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Gældende pris mellem den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato og slutdatoen	Gældende pris mellem den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato og den ikke-regulerede slutdato inklusive.
53	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Pris for pakketransaktioner	Den handlede pris for hele den pakke, hvori den indberettede derivattransaktion indgår som komponent. Dette dataelement er ikke relevant, såfremt <ul style="list-style-type: none"> • der ikke er tale om en pakke, eller • der anvendes et spread for pakketransaktioner. Priser og relaterede dataelementer for transaktionerne (prisvaluta), der repræsenterer de enkelte komponenter i pakken, indberettes, når de foreligger. Prisen for pakketransaktioner kendes muligvis ikke, når en ny transaktion indberettes, men kan ajourføres senere.
54	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Valuta for prisen på pakketransaktioner	Valuta, i hvilken prisen er denomineret. Dette dataelement er ikke relevant, såfremt <ul style="list-style-type: none"> • der ikke er tale om en pakke, eller

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<ul style="list-style-type: none"> • der anvendes et spread for pakkeoperationer, eller • prisen for pakkeoperationer udtrykkes i procent.
55	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel værdi af første ben	Notionel værdi af første ben som omhandlet i artikel 5 i denne forordning
56	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel valuta 1	Hvis relevant: den valuta, som den notionelle værdi af første ben er denomineret i.
	Felt 57 til 59 gentages og skal udfyldes, hvis der er tale om derivater, der omfatter oversigterne over notionel værdi		
57	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den notionelle værdi af første ben	Ikke-reguleret dato, hvor den tilknyttede nominelle værdi af første ben får virkning
58	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den notionelle værdi af første ben	Ikke-reguleret slutdato for den notionelle værdi af første ben (ikke relevant, hvis den ikke-regulerede slutdato for en given tidsperiode ligger i forlængelse af den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato for den efterfølgende periode).
59	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel værdi, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for første ben	Notionel værdi af første ben, der træder i kraft på den tilknyttede ikke-justerede ikrafttrædelsesdato.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
60	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Samlet notional mængde af første ben	Samlet notional mængde af det underliggende aktiv for første ben i transaktionens løbetid. Hvis den samlede nominelle mængde er ukendt, når en ny transaktion indberettes, ajourføres den samlede nominelle mængde, efterhånden som den foreligger.
	Felt 61 til 63 gentages og skal udfyldes, hvis der er tale om derivater, der omfatter oversigterne over notional mængde		
61	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den nominelle mængde af første ben	Ikke-reguleret dato, hvor den tilknyttede nominelle mængde af første ben får virkning
62	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den nominelle mængde af første ben	Ikke-reguleret slutdato for den nominelle mængde af første ben (ikke relevant, hvis den ikke-regulerede slutdato for en given tidsperiode ligger i forlængelse af den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato for den efterfølgende periode).
63	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notional mængde, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for første ben	Notional værdi af første ben, der får virkning på den tilknyttede ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato.
64	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionelt beløb for andet ben	I givet fald den nominelle værdi af andet ben som omhandlet i artikel 5 i denne forordning.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
65	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel valuta 2	Hvis relevant: den valuta, som den notionelle værdi af andet ben er denomineret i.
	Felt 66 til 68 gentages og skal udfyldes, hvis der er tale om derivater, der omfatter oversigterne over notionel værdi		
66	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den notionelle værdi af andet ben	Ikke-reguleret dato, hvor den tilknyttede nominelle værdi af andet ben får virkning
67	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den notionelle værdi af andet ben	Ikke-reguleret slutdato for den notionelle værdi af andet ben (ikke relevant, hvis den ikke-regulerede slutdato for en given tidsperiode ligger i forlængelse af den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato for den efterfølgende periode).
68	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel værdi, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for andet ben	Notionel værdi af andet ben, der får virkning på den tilknyttede ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato.
69	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Samlet notionel mængde af andet ben	Samlet notionel mængde af det underliggende aktiv for andet ben i transaktionens løbetid. Hvis den samlede nominelle mængde er ukendt, når en ny transaktion indberettes, ajourføres den samlede nominelle mængde, efterhånden som den foreligger.
	Felt 70 til 72 gentages og skal udfyldes, hvis der er		

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
	tale om derivater, der omfatter oversigterne over notionel mængde		
70	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Ikrafttrædelsesdato for den notionelle mængde af andet ben	Ikke-reguleret dato, hvor den tilknyttede nominelle mængde af andet ben får virkning
71	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Slutdato for den notionelle mængde af andet ben	Ikke-reguleret slutdato for den notionelle mængde af andet ben (ikke relevant, hvis den ikke-regulerede slutdato for en given tidsperiode ligger i forlængelse af den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato for den efterfølgende periode).
72	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Notionel mængde, der gælder på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato for andet ben	Notionel værdi af andet ben, der får virkning på den tilknyttede ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato.
	Afsnittets felt 73 til 78 gentages		
73	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Anden betalingstype	Type af andet betalingsbeløb. Udbetaling af optionspræmie er ikke medtaget som en betalingstype, da præmier for optioner indberettes ved hjælp af optionens særlige dataelement.
74	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Andet betalingsbeløb	Betalinger med tilsvarende betalingstyper for at tage højde for krav om transaktionsbeskrivelser fra forskellige aktivklasser.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
75	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Anden betalingsvaluta	Valuta, i hvilken andet betalingsbeløb er denomineret.
76	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Anden betalingsdato	Ikke-reguleret dato for betaling af det andet betalingsbeløb.
77	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Indbetaler af andre betalingsbeløb	Identifikator for indbetaleren af andre betalingsbeløb.
78	Afdeling 2g — Nærmere oplysninger om transaktionen	Modtager af andre betalingsbeløb	Identifikator for modtageren af andre betalingsbeløb.
79	Afdeling 2h — Rentesatser	Fast rente for første ben eller kuponbetaling	I givet fald angivelse af den faste rente for første ben eller den anvendte kupon.
80	Afdeling 2h — Rentesatser	Konvention for renteberegningsdage for den faste rente for første ben eller for kuponbetaling	Hvis relevant: konvention for renteberegningsdage (ofte også omtalt som dagtællingsbrøk eller dagtællingsmetode), der fastlægger beregningen af rentebetalingen. Den anvendes til at beregne brøkdelen på årsbasis af beregningsperioden og angiver antallet af dage i beregningsperioden divideret med antallet af dage i året.
81	Afdeling 2h — Rentesatser	Hyppigheden for betaling af den faste rente for første ben eller for kuponbetaling	Hvis relevant: tidsenhed forbundet med betalingshyppigheden, f.eks. dag, uge, måned, år eller løbetid for strømmen af betalinger for den faste rente for første ben eller for kuponbetaling.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
82	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for hyppigheden for betaling af den faste rente for første ben eller for kuponbetaling	Hvis relevant: antal tidsenheder (udtrykt ved betalingshyppigheden), der bestemmer hyppigheden af periodiske betalingsdatoer for den faste rente for første ben eller for kuponbetaling. Eksempelvis repræsenteres en transaktion med betalinger, der finder sted hver anden måned, med en betalingshyppighed på "MNTH" (månedlig) og en multiplikationsfaktor for betalingshyppighed på 2. Dette dataelement er ikke relevant, hvis betalingshyppigheden er "ADHO". Hvis betalingshyppigheden er "EXPI", er multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden 1. Hvis betalingshyppigheden er intradag, er betalingshyppigheden "DAIL", og multiplikatoren for betalingsfrekvensen er 0.
83	Afdeling 2h — Rentesatser	Identifikator for den variable rente for første ben	Hvis relevant: en identifikator for de rentesatser, der anvendes, og som genfastsættes med faste mellemrum, under henvisning til en markedsreferencerente.
84	Afdeling 2h — Rentesatser	Indikator for den variable rente for første ben	I givet fald en angivelse af rentesatsen.
85	Afdeling 2h — Rentesatser	Navnet på den variable rente for første ben	Det fulde navn på den rentesats, der er tildelt af indeksleverandøren.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
86	Afdeling 2h — Rentesatser	Konvention for renteberegningsdage for den variable rente for første ben	Hvis relevant: konvention for renteberegningsdage (ofte også omtalt som dagtællingsbrøk eller dagtællingsmetode), der fastlægger beregningen af rentebetalinger for den variable rente for første ben. Den anvendes til at beregne brøkdelen på årsbasis af beregningsperioden og angiver antallet af dage i beregningsperioden divideret med antallet af dage i året.
87	Afdeling 2h — Rentesatser	Betalingshyppigheden for den variable rente for første ben	Hvis relevant: tidsenhed forbundet med betalingshyppigheden, f.eks. dag, uge, måned, år eller løbetid for strømmen af betalinger for den variable rente for første ben.
88	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden for den variable rente for første ben	Hvis relevant: antal tidsenheder (udtrykt ved betalingshyppigheden), der bestemmer hyppigheden af periodiske betalingsdatoer for den variable rente for første ben. Eksempelvis repræsenteres en transaktion med betalinger, der finder sted hver anden måned, med en betalingshyppighed på "MNTH" (månedlig) og en multiplikationsfaktor for betalingshyppighed på 2. Dette dataelement er ikke relevant, hvis betalingshyppigheden er "ADHO". Hvis betalingshyppigheden er "EXPI", er

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden 1. Hvis betalingshyppigheden er intradag, er betalingshyppigheden "DAIL", og multiplikationsfaktoren for betalingsfrekvensen er 0.
89	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for første ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rente for første ben.
90	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for første ben — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rente for første ben.
91	Afdeling 2h — Rentesatser	Tilpasning af hyppigheden for den variable rente for første ben	Hvis relevant: tidsenhed forbundet med hyppigheden af betalingstilpasninger, f.eks. dag, uge, måned, år eller løbetid for strømmen af betalinger for den variable rente for første ben.
92	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for tilpasning af hyppigheden for den variable rente for første ben	Hvis relevant: antal tidsenheder (udtrykt ved betalingshyppigheden), der bestemmer hyppigheden af tilpasninger af periodiske betalingsdatoer for den variable rente for første ben. Eksempelvis repræsenteres en transaktion med betalinger, der finder sted hver anden måned, med en betalingshyppighed på "MNTH" (månedlig) og en multiplikationsfaktor for

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			betalingshyppighed på 2. Dette dataelement er ikke relevant, hvis betalingshyppigheden er "ADHO". Hvis betalingshyppigheden er "EXPI", er multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden 1. Hvis betalingshyppigheden er intradag, er betalingshyppigheden "DAIL", og multiplikationsfaktoren for betalingsfrekvensen er 0.
93	Afdeling 2h — Rentesatser	Spreadet for første ben	I givet fald angivelse af spreadet for første ben. for OTC-derivattransaktioner med periodiske betalinger (f.eks. swaps med fast rente/variabel rente, basisswaps, råvarebaserede swaps) <ul style="list-style-type: none"> • spread på referenceprisen på indekset for de enkelte variable ben, hvis der er et spread på et eller flere variable ben. • forskellen mellem referencepriserne for de to indekser for de variable dele.
94	Afdeling 2h — Rentesatser	Valuta for spreadet for første ben	Hvis relevant: den valuta, som spreadet for første ben er denomineret i. Dette dataelement anvendes kun, hvis spreadet udtrykkes som pengeværdi.
95	Afdeling 2h — Rentesatser	Fast rente for andet ben	I givet fald angivelse af den faste rente for andet ben.
96	Afdeling 2h —	Konvention for renteberegningsdage for	Hvis relevant: konvention for renteberegningsdage

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
	Rentesatser	den faste rente for andet ben	(ofte også omtalt som dagtællingsbrøk eller dagtællingsmetode), der fastlægger beregningen af rentebetalinger. Den anvendes til at beregne brøkdelen på årsbasis af beregningsperioden og angiver antallet af dage i beregningsperioden divideret med antallet af dage i året.
97	Afdeling 2h — Rentesatser	Betalingshyppigheden for den faste rente for andet ben	Hvis relevant: tidsenhed forbundet med betalingshyppigheden, f.eks. dag, uge, måned, år eller løbetid for strømmen af betalinger for den faste rente for andet ben.
98	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden for den faste rente for andet ben	Hvis relevant: antal tidsenheder (udtrykt ved betalingshyppigheden), der bestemmer hyppigheden af periodiske betalingsdatoer for den faste rente for andet ben. Eksempelvis repræsenteres en transaktion med betalinger, der finder sted hver anden måned, med en betalingshyppighed på "MNTH" (månedlig) og en multiplikationsfaktor for betalingshyppighed på 2. Dette dataelement er ikke relevant, hvis betalingshyppigheden er "ADHO". Hvis betalingshyppigheden er "EXPI", er multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden 1. Hvis betalingshyppigheden er intradag, er betalingshyppigheden "DAIL", og

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			multiplikationsfaktoren for betalingsfrekvensen er 0.
99	Afdeling 2h — Rentesatser	Identifikator for den variable rente for andet ben	Hvis relevant: En identifikator for de rentesatser, der anvendes, og som genfastsættes med faste mellemrum, under henvisning til en markedsreferencerente.
100	Afdeling 2h — Rentesatser	Indikator for den variable rente for andet ben	I givet fald en angivelse af rentesatsen.
101	Afdeling 2h — Rentesatser	Navnet på den variable rente for andet ben	Det fulde navn på den rentesats, der er tildelt af indeksleverandøren.
102	Afdeling 2h — Rentesatser	Konvention for renteberegningsdage for den variable rente for andet ben	Hvis relevant: konvention for renteberegningsdage (ofte også omtalt som dagtællingsbrøk eller dagtællingsmetode), der fastlægger beregningen af rentebetalinger for den variable rente for andet ben. Den anvendes til at beregne brøkdelen på årsbasis af beregningsperioden og angiver antallet af dage i beregningsperioden divideret med antallet af dage i året.
103	Afdeling 2h — Rentesatser	Betalingshyppigheden for den variable rente for andet ben	Hvis relevant: tidsenhed forbundet med betalingshyppigheden, f.eks. dag, uge, måned, år eller løbetid for strømmen af betalinger for den variable rente for andet ben.
104	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden	Hvis relevant: antal tidsenheder (udtrykt ved

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
		for den variable rente for andet ben	betalingshyppigheden), der bestemmer hyppigheden af periodiske betalingsdatoer for den variable rente for andet ben. Eksempelvis repræsenteres en transaktion med betalinger, der finder sted hver anden måned, med en betalingshyppighed på "MNTM" (månedlig) og en multiplikationsfaktor for betalingshyppighed på 2. Dette dataelement er ikke relevant, hvis betalingshyppigheden er "ADHO". Hvis betalingshyppigheden er "EXPI", er multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden 1. Hvis betalingshyppigheden er intradag, er betalingshyppigheden "DAIL", og multiplikationsfaktoren for betalingsfrekvensen er 0.
105	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — tidsperiode	Tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rente for andet ben.
106	Afdeling 2h — Rentesatser	Referenceperiode for den variable rente for andet ben — multiplikator	Multiplikator for den tidsperiode, der beskriver referenceperioden for den variable rente for andet ben.
107	Afdeling 2h — Rentesatser	Tilpasning af hyppigheden for den variable rente for andet ben	Hvis relevant: tidsenhed forbundet med hyppigheden af betalingstilpasninger, f.eks. dag, uge, måned, år eller løbetid for strømmen af betalinger for den variable rente for andet

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			ben.
108	Afdeling 2h — Rentesatser	Multiplikationsfaktoren for tilpasning af hyppigheden for den variable rente for andet ben	Hvis relevant: antal tidsenheder (udtrykt ved betalingshyppigheden), der bestemmer hyppigheden af tilpasninger af periodiske betalingsdatoer for den variable rente for andet ben. Eksempelvis repræsenteres en transaktion med betalinger, der finder sted hver anden måned, med en betalingshyppighed på "MNTH" (månedlig) og en multiplikationsfaktor for betalingshyppighed på 2. Dette dataelement er ikke relevant, hvis betalingshyppigheden er "ADHO". Hvis betalingshyppigheden er "EXPI", er multiplikationsfaktoren for betalingshyppigheden 1. Hvis betalingshyppigheden er intradag, er betalingshyppigheden "DAIL", og multiplikationsfaktoren for betalingsfrekvensen er 0.
109	Afdeling 2h — Rentesatser	Spreadet for andet ben	I givet fald angivelse af spreadet for andet ben. for OTC-derivattransaktioner med periodiske betalinger (f.eks. swaps med fast rente/variabel rente, basisswaps, råvarebaserede swaps) <ul style="list-style-type: none"> • spread på referenceprisen på indekset for de enkelte variable ben, hvis der er et

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			spread på et eller flere variable ben. <ul style="list-style-type: none"> • forskellen mellem referencepriserne for de to indekser for de variable dele.
110	Afdeling 2h — Rentesatser	Valuta for spreadet for andet ben	Hvis relevant: den valuta, som spreadet for andet ben er denomineret i. Dette dataelement anvendes kun, hvis spreadet udtrykkes som pengeværdi.
111	Afdeling 2h — Rentesatser	Spread for pakketransaktioner	Den handlede pris for hele den pakke, hvori den indberettede derivattransaktion indgår som komponent i en pakke­transaktion. Pris på pakke­transaktioner, når prisen på pakken udtrykkes som et spread, en forskel mellem to referencepriser. Dette dataelement er ikke relevant, såfremt <ul style="list-style-type: none"> • der ikke er tale om en pakke, eller • der anvendes en pris for pakke­transaktioner eller Priser og relaterede dataelementer for transaktionerne (spreadets valuta), der repræsenterer de enkelte komponenter i pakken, indberettes, når de foreligger. Spreadet for pakke­transaktioner kendes muligvis ikke, når en ny transaktion indberettes, men kan ajourføres senere.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
112	Afdeling 2h — Rentesatser	Valuta for spreadet på pakke­transaktioner	Valuta, i hvilken spreadet for pakke­transaktioner er denomineret. Dette dataelement er ikke relevant, såfremt <ul style="list-style-type: none"> • der ikke er tale om en pakke, eller • der anvendes en pris for pakke­transaktioner eller • spreadet for pakke­transaktioner udtrykkes i procent eller i basispoint.
113	Afdeling 2i — Udenlandsk valuta	Valutakurs 1	Vekselkurs mellem de to forskellige valutaer, der er angivet i derivat­transaktionen, som modparterne blev enige om ved transaktionens indgåelse, udtrykt som vekselkursen ved omregning af enhedsvalutaen til den noterede valuta.
114	Afdeling 2i — Udenlandsk valuta	Valutaterminkurs	Valutaterminkurs som aftalt mellem modparterne i den kontraktlige aftale. Angives som basisvalutapris i noteringsvalutaen.
115	Afdeling 2i — Udenlandsk valuta	Valutakursgrundlag	Valutapar og -orden, hvori valutakursen er denomineret, udtrykt som enhedsvaluta eller noteret valuta.
116	Afdeling 2j — Råvarer og emissionskvoter (generelt)	Basisprodukt	Basisprodukt som angivet i varenomenklaturen i tabel 4 i bilaget til <i>[Publikationskontoret: Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588].</i>

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
117	Afdeling 2j — Råvarer og emissionskvoter (generelt)	Underprodukt	Underprodukt som angivet i varenomenklaturen i tabel 4 i bilaget til [Publikationskontoret: <i>Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588</i>]. Dette felt kræver et specifikt basisprodukt.
118	Afdeling 2j — Råvarer og emissionskvoter (generelt)	Yderligere underprodukt	Yderligere underprodukt som angivet i varenomenklaturen i tabel 4 i bilaget til [Publikationskontoret: <i>Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588</i>]. Dette felt kræver et specifikt underprodukt.
119	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Leveringssted eller -område	Leveringssted(er) eller markedsområde(r).
120	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Forbindelsespunkt	Angivelse af grænsen (grænserne) eller grænseovergangen(e) i forbindelse med en transportaftale.
121	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Belastningstype	Angivelse af leveringsprofilen.
	Afsnittets felt 122 til 131 gentages		
122	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Begyndelsestidspunkt for leveringsinterval	Begyndelsestidspunktet for leveringsintervallet for den enkelte blok eller form.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
123	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Sluttidspunkt for leveringsinterval	Sluttidspunktet for leveringsintervallet for den enkelte blok eller form.
124	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Begyndelsestidspunkt for levering	Begyndelsestidspunkt for leveringen.
125	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Slutdato for levering	Slutdato for leveringen.
126	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Varighed	Leveringsperiodens varighed.
127	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Ugedage	Leveringsugedage.
128	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Leveringskapacitet	Antallet af enheder, der indgår i transaktionen for hvert leveringsinterval angivet i felt 122 og 123.
129	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Antal enheder	Den anvendte måleenhed.
130	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Prisen på og tidsintervallet for mængde	I givet fald pris pr. mængde pr. leveringstidsinterval.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
131	Afdeling 2k — Råvarer og emissionskvoter (energi)	Valuta for prisen på og tidsintervallet for mængden	Den valuta, som prisen pr. mængde pr. leveringstidsinterval angives i.
132	Afdeling 2l — Optioner	Optionsform	<p>Angivelse af, hvorvidt derivataftalen er en call-option (ret til at købe et bestemt underliggende aktiv) eller en put-option (ret til at sælge et bestemt underliggende aktiv), eller af, hvorvidt det på det tidspunkt, hvor derivataftalen gennemføres, ikke kan bestemmes, om den er en call- eller en put-option.</p> <p>I forbindelse med swaptioner er der tale om:</p> <ul style="list-style-type: none"> - "Put" i tilfælde af en modtagerswaption, hvor køberen har ret til at indgå i en swap som modtager af fast rente - "Call" i tilfælde af en betalerswaption, hvor køberen har ret til at indgå i en swap som betaler af fast rente. <p>Hvis der er tale om rentelofter og minimumsrentesatser ("caps and floors"), gælder følgende:</p> <ul style="list-style-type: none"> "Put" i tilfælde af en minimumsrentesats. "Call" i tilfælde af et renteloft.
133	Afdeling 2l — Optioner	Optionstype	Angiver, hvorvidt optionen kun kan udnyttes på en bestemt dato (europæisk option), på en række forud fastsatte datoer (Bermuda-option) eller når som helst i aftalens løbetid

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			(amerikansk option).
134	Afdeling 21 — Optioner	Strikepris	<ul style="list-style-type: none"> • For andre optioner end valutaoptioner, swaptioner og lignende produkter, den pris, til hvilken ejeren af en option kan købe eller sælge optionens underliggende aktiv. • For valutaoptioner den valutakurs, hvortil optionen kan udnyttes, udtrykt som vekselkursen fra omregning af enhedsvalutaen til den noterede valuta. I eksemplet 0,9426 USD/EUR er USD enhedsvalutaen, og EUR er den noterede valuta. USD 1 = EUR 0.9426. Hvis strikeprisen er ukendt, når en ny transaktion indberettes, ajourføres strikeprisen, efterhånden som den foreligger. • For volatilitets- og variansswaps og lignende produkter indberettes strikeprisen for volatilitet i dette dataelement.
	Felt 135 til 137 gentages og skal udfyldes, hvis der er tale om derivater, der omfatter oversigterne over strikepriser		
135	Afdeling 21 — Optioner	Ikrafttrædelsesdato for strikeprisen	Ikke-reguleret ikrafttrædelsesdato for strikeprisen
136	Afdeling 21 — Optioner	Slutdato for strikeprisen	Ikke-reguleret slutdato for strikeprisen (ikke relevant, hvis den ikke-regulerede slutdato

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			for en given tidsperiode ligger i forlængelse af den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato for den efterfølgende periode).
137	Afdeling 21 — Optioner	Strikepris gældende på den tilknyttede ikrafttrædelsesdato	Strikepris gældende mellem den ikke-regulerede ikrafttrædelsesdato og den ikke-regulerede slutdato inklusive.
138	Afdeling 21 — Optioner	Strikeprisvaluta/valutapar	For aktieoptioner, råvareoptioner og lignende produkter, den valuta, som strikeprisen er denomineret i. For valutaoptioner: Valutapar og rækkefølge ved angivelse af strikepris. Den udtrykkes som enhedsvaluta pr. noteringsvaluta.
139	Afdeling 21 — Optioner	Optionspræmiebeløb	For optioner og swaptioner for alle aktivklasser, pengebeløb betalt af optionskøberen. Dette dataelement er ikke relevant, hvis instrumentet ikke er en option eller ikke omfatter nogen optionalitet.
140	Afdeling 21 — Optioner	Optionspræmievaluta	For optioner og swaptioner for alle aktivklasser, den valuta, hvori optionspræmien er denomineret. Dette dataelement er ikke relevant, hvis instrumentet ikke er en option eller ikke omfatter nogen optionalitet.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
141	Afdeling 2l — Optioner	Dato for betaling af optionspræmie	Ikke-reguleret dato for betaling af optionspræmie.
142	Afdeling 2i — Optioner	Udløbsdato for det underliggende aktiv	I tilfælde af swaptioner, udløbsdato for den underliggende swap.
143	Afdeling 2m — Kreditderivater	Rang	Angiver rangordenen for det gældsværdipapir eller den gældskurv eller det indeks, der ligger til grund for et derivat.
144	Afdeling 2m — Kreditderivater	Referenceenhed	Angivelse af den underliggende referenceenhed.
145	Afdeling 2m — Kreditderivater	Serier	Hvis det er relevant, serienummeret for sammensætningen af indekset.
146	Afdeling 2m — Kreditderivater	Version	Der udstedes en ny version af en serie, hvis en af komponenterne misligholder, og indekset skal vægtes på ny, for at der kan tages højde for det nye antal komponenter i indekset.
147	Afdeling 2m — Kreditderivater	Indeksfaktor	Den faktor, der skal anvendes i forbindelse med den notionelle værdi (felt 55 i denne tabel) for at tilpasse den til alle de tidligere kredithændelser i den pågældende indeksserie.
148	Afdeling 2m — Kreditderivater	Tranche	Angivelse af, om en derivataftale er opdelt i trancher.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
149	Afdeling 2m — Kreditderivater	Attachment point for swap baseret på en Credit Default Swap (CDS)	Defineret lavere punkt, hvor tabsniveauet i den underliggende portefølje reducerer tranchens notionelle værdi. Eksempelvis vil den notionelle værdi i en tranche med et attachment point på 3 % blive reduceret, når der er realiseret 3 % af tabene i porteføljen. Dette dataelement er ikke relevant, hvis transaktionen ikke er en CDS-transaktion i trancher (indeks eller kundespecifik kurv).
150	Afdeling 2m — Kreditderivater	Detachment point for CDS-indeks	Defineret punkt, hvorefter tab i den underliggende portefølje ikke længere reducerer tranchens notionelle værdi. Eksempelvis vil den notionelle værdi i en tranche med et attachment point på 3 % og et detachment point på 6 % blive reduceret, når der har været 3 % af tabene i porteføljen. 6 % tab i porteføljen udhuler tranchens notionelle værdi. Dette dataelement er ikke relevant, hvis transaktionen ikke er en CDS-transaktion i trancher (indeks eller kundespecifik kurv).
151	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Type handling	<ul style="list-style-type: none"> • Nyt: En indberetning om et derivat på handels- eller positionsniveau for første gang. • Ændring: En ændring af vilkårene eller de nærmere

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<p>oplysninger om et tidligere indberettet derivat på handels- eller positionsniveau, men ikke en korrektion af en indberetning.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Rettelse: En indberetning, der korrigerer de fejlagtige datafelter i en tidligere indsendt indberetning. • Afvikling: En afvikling af et eksisterende derivat på handels- eller positionsniveau. • Fejl: en annullering af en fejlagtigt indgivet fuldstændig indberetning, hvis aftalen aldrig blev indgået på handels- eller positionsniveau, aldrig blev til virkelighed eller ikke var omfattet af kravene om indberetning i forordning (EU) nr. 648/2012, men blev indberettet til et transaktionsregister ved en fejl, eller en annullering af en indberetning, der er indgivet to gange. • Genåbning: Genåbning af et derivat på handels- eller positionsniveau, som blev annulleret med handlingstypen "Fejl" eller afviklet ved en fejl. • Vurdering: En ajourføring af en vurdering af et derivat på handels- eller positionsniveau. • Positionskomponent: En indberetning af et nyt derivat, der indgår i en særskilt positionsindberetning samme dag.

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
152	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Hændelsestype	<ul style="list-style-type: none"> • Handel: Indgåelse af et derivat eller genforhandling af dets vilkår, som ikke fører til ændring af en modpart • Indtrædelse: En hændelse, hvor hele eller en del af derivatet overføres til en modpart 2 (og indberettes som et nyt derivat), og det eksisterende derivat enten afvikles, eller dets nominelle værdi ændres. • PTRR: Efterhandelstjenesteydelse r til risikoreduktion • Førtidig afvikling: Afvikling af et derivat på handels- eller positionsniveau. • Clearing: Clearing som defineret i artikel 2, nr. 3), i forordning (EU) nr. 648/2012 • Udnyttelse: En af transaktionens modparters udnyttelse af en option eller en swaption, helt eller delvis. • Allokering: Allokeringshændelse, hvor et eksisterende derivat allokeres til forskellige modparter og indberettes som nye derivater med reducerede nominelle værdier. • Kredithændelse: Gælder kun for kreditderivater. En kredithændelse, som fører til en ændring af et derivat på handels- eller positionsniveau. Virksomhedshændelse: En virksomhedsaktion vedrørende egenkapital

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<p>som underliggende aktiv, der påvirker derivaterne på den pågældende egenkapital</p> <ul style="list-style-type: none"> • Optagelse i position: Optagelse af CCP-clearede derivater eller CFD i en position, hvor et eksisterende derivat afvikles, og der oprettes enten en ny position, eller den notionelle værdi af en eksisterende position ændres. <p>Ajourføring — Ajourføring af et udestående derivat i overgangsperioden for at sikre, at det er i overensstemmelse med de ændrede indberetningskrav</p>
153	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Dato for begivenhed	Den dato, hvor den indberetningspligtige hændelse vedrørende derivataftalen, der er omfattet af indberetningen, fandt sted, eller ved en ændring af den dato, hvor ændringen træder i kraft.
154	Afdeling 2n — Ændringer af derivatet	Niveau	Angivelse af, om indberetningen sker på transaktions- eller positionsniveau. Indberetning på positionsniveau kan udelukkende anvendes som et supplement til indberetning på transaktionsniveau med henblik på at indberette efterfølgende transaktionshændelser og udelukkende, hvis de individuelle transaktioner i fungible produkter er

	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			erstattet af en position.

Tabel 3

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
1	Derivatets parter	Tidsstempel for indberetningen	Dato og klokkeslæt for indberetningen til transaktionsregistret.
2	Derivatets parter	ID for indberettende enhed	Hvis enheden med ansvar for indberetningen har delegeret indgivelsen af indberetningen til en tredjepart eller til den anden modpart, skal der i dette felt anføres en entydig identifikationskode for denne enhed. Ellers skal enheden med ansvar for indberetningen identificeres i dette felt.
3	Derivatets parter	Enhed med ansvar for indberetningen	Hvis en finansiel modpart er eneansvarlig og er juridisk ansvarlig for indberetning på begge modparters vegne i overensstemmelse med artikel 9, stk. 1a, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012, og den ikke-finansielle modpart ikke selv beslutter at indberette oplysninger om sine OTC-derivataftaler med den finansielle modpart, angives den entydige identifikationskode for denne finansielle modpart. Hvis et administrationsselskab er ansvarligt og juridisk ansvarligt for indberetningen på vegne af et institut for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitut) i henhold til artikel 9, stk. 1b), i nævnte forordning, angives den entydige identifikationskode for det pågældende administrationsselskab. Hvis en forvalter af alternative investeringsfonde (FAIF'er) er ansvarlig og juridisk ansvarlig for indberetningen på vegne af en alternativ

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<p>investeringsfond (AIF) i henhold til artikel 9, stk. 1c), i den pågældende forordning, den entydige identifikationskode for denne FAIF. Hvis en godkendt enhed, der er ansvarlig for forvaltningen og handler på vegne af en IORP, er ansvarlig og juridisk ansvarlig for indberetning på dens vegne i overensstemmelse med artikel 9, stk. 1d), i nævnte forordning, den unikke kode til identifikation af denne enhed.</p> <p>Dette felt gælder kun for OTC-derivater.</p>
4	Derivatets parter	Modpart 1 (Indberettende modpart)	<p>Identifikator for modparten i en derivattransaktion, som opfylder sin indberetningspligt gennem den pågældende indberetning.</p> <p>Ved en allokeret derivattransaktion, der gennemføres af en fondsforvalter på vegne af en fond, indberettes fonden og ikke fondsforvalteren som modpart.</p>
5	Derivatets parter	Type identifikator for modpart 2	Indikator for, hvorvidt LEI-koden blev anvendt til at identificere modpart 2.
6	Derivatets parter	Modpart 2	<p>Identifikator for den anden modpart i en derivattransaktion.</p> <p>Ved en allokeret derivattransaktion, der gennemføres af en fondsforvalter på vegne af en fond, indberettes fonden og ikke fondsforvalteren som modpart.</p>
7	Sikkerhedsstillelse	Tidsstempel for sikkerhedsstillelse	Dato og klokkeslæt for, hvornår marginerne indberettes.

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
8	Sikkerhedsstillelse	Indikator for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Indikator for, hvorvidt sikkerhedsstillelsen blev stillet på porteføljebasis. Ved "på porteføljebasis" forstås et sæt transaktioner, der er forbundet med marginer (enten på netto- eller bruttobasis) i modsætning til det scenarie, hvor marginen beregnes og stilles særskilt for hver enkelt transaktion.
9	Sikkerhedsstillelse	Kode for sikkerhedsstillelse på porteføljebasis	Hvis sikkerhedsstillelsen indberettes på porteføljebasis, en entydig kode tildelt af modpart 1 til porteføljen. Dette dataelement er ikke relevant, hvis sikkerhedsstillelsen blev udført på transaktionsniveau, eller hvis der ikke foreligger en aftale om sikkerhedsstillelse, eller hvis der ikke stilles eller modtages sikkerhed.
10	Sikkerhedsstillelse	UTI (unik handelsidentifikator)	Unik handelsidentifikator som omhandlet i artikel 7 i [<i>Publikationskontoret: Indsæt venligst henvisning til C(2022) 3588</i>].
11	Sikkerhedsstillelse	Kategorien for sikkerhedsstillelse	Angivelse af, hvorvidt modparterne har indgået en aftale om sikkerhedsstillelse. Dette dataelement angives for hver transaktion eller portefølje, afhængigt af om sikkerhedsstillelsen foretages på transaktions- eller porteføljeniveau og gælder for både cleared og ikke-cleared transaktioner.

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
12	Sikkerhedsstillelse	Initialmargin stillet af modpart 1 (før haircut)	<p>Pengeværdien af den initialmargin, der er stillet af modpart 1, herunder eventuelle marginer, der er i transit og afventer afvikling.</p> <p>Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den stillede initialmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den stillede initialmargin hele porteføljen.</p> <p>Dette felt henviser til initialmarginens samlede aktuelle værdi snarere end til den daglige ændring.</p> <p>Dataelementet vedrører både ikke-clearede og centralt clearede transaktioner. For centralt clearede transaktioner omfatter dataelementet ikke bidrag til misligholdelsesfonden eller sikkerhed stillet mod likviditetshensættelser over for CCP'en, dvs. bevilgede kreditlinjer.</p> <p>Hvis den stillede initialmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én samlet værdi.</p>
13	Sikkerhedsstillelse	Initialmargin stillet af modpart 1 (efter haircut)	<p>Pengeværdien af den initialmargin, der er stillet af modpart 1, herunder eventuelle marginer, der er i transit og afventer afvikling.</p> <p>Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den stillede initialmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den stillede initialmargin hele porteføljen.</p> <p>Dette felt henviser til initialmarginens samlede aktuelle værdi i givet fald efter en haircut snarere end til den daglige ændring.</p> <p>Dataelementet vedrører både ikke-clearede og centralt clearede transaktioner. For centralt clearede transaktioner omfatter dataelementet ikke bidrag til misligholdelsesfonden eller sikkerhed</p>

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			stillet mod likviditetshensættelser over for CCP'en, dvs. bevilgede kreditlinjer. Hvis den stillede initialmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én samlet værdi.
14	Sikkerhedsstillelse	Valuta for den stillede initialmargin	Valuta, i hvilken den stillede initialmargin er denomineret. Hvis den stillede initialmargin er denomineret i mere end én valuta, afspejler dette dataelement en af de valutaer, som modpart 1 har valgt at konvertere alle værdier af stillede initialmargin til.
15	Sikkerhedsstillelse	Variationsmargin stillet af modpart 1 (før haircut)	Pengeværdien af variationsmarginen stillet af modpart 1, herunder den kontant afregnede margin og en eventuel margin, der er i transit og afventer afvikling. En variationsmargin for uforudsete udgifter er ikke medtaget. Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den stillede variationsmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages for enkelte transaktioner, vedrører den stillede variationsmargin hele porteføljen. Dette felt henviser til den samlede aktuelle værdi af variationsmarginen, kumuleret siden den første indberetning af variationsmargin, der er stillet for porteføljen eller transaktionen. Hvis den stillede variationsmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én samlet værdi.
16	Sikkerhedsstillelse	Variationsmargin stillet af modpart 1 (efter haircut)	Pengeværdien af variationsmarginen stillet af modpart 1, herunder den kontant afregnede margin og en eventuel margin, der er i transit og afventer afvikling. En variationsmargin for uforudsete

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<p>udgifter er ikke medtaget.</p> <p>Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den stillede variationsmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages for enkelte transaktioner, vedrører den stillede variationsmargin hele porteføljen.</p> <p>Dette felt henviser til den samlede aktuelle værdi af variationsmarginen i givet fald efter en haircut, kumuleret siden den første indberetning af variationsmarginer, der er stillet for porteføljen eller transaktionen.</p> <p>Hvis den stillede variationsmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én samlet værdi.</p>
17	Sikkerhedsstillelse	Valuta for den stillede variationsmargin	<p>Valuta, i hvilken den stillede variationsmargin er denomineret.</p> <p>Hvis den stillede variationsmargin er denomineret i mere end én valuta, afspejler dette dataelement en af de valutaer, som modpart 1 har valgt at konvertere alle værdier af stillede variationsmarginer til.</p>
18	Sikkerhedsstillelse	Overskydende sikkerhed stillet af modpart 1	<p>Pengeværdien af en eventuel yderligere sikkerhed stillet af modpart 1, og som er separat og uafhængig af initial- og variationsmarginen. Dette felt henviser til den samlede aktuelle værdi af den overskydende sikkerhedsstillelse i givet fald inden en haircut snarere end til den daglige ændring.</p> <p>Alle stillede initial- eller variationsmarginbeløb, der overstiger den krævede initial- eller variationsmargin, indberettes som en del af henholdsvis den stillede initial- eller variationsmargin og ikke som overskydende stillet sikkerhed.</p> <p>For centralt clearede transaktioner indberettes overskydende sikkerhedsstillelse kun i det omfang, den kan henføres til en bestemt portefølje eller</p>

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			transaktion.
19	Sikkerhedsstillelse	Valuta for den overskydende sikkerhedsstillelse	Valuta, i hvilken den overskydende sikkerhedsstillelse er denomineret. Hvis den overskydende sikkerhedsstillelse er denomineret i mere end én valuta, afspejler dette dataelement en af de valutaer, som modpart 1 har valgt at konvertere alle værdier af den overskydende sikkerhedsstillelse til.
20	Sikkerhedsstillelse	Initialmargin opkrævet af modpart 1 (før haircut)	Pengeværdien af den initialmargin, der er opkrævet af modpart 1, herunder eventuelle marginer, der er i transit og afventer afvikling. Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede initialmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede initialmargin hele porteføljen. Dette felt henviser til initialmarginens samlede aktuelle værdi snarere end til den daglige ændring. Dataelementet vedrører både ikke-cleared og centralt cleared transaktioner. For centralt cleared transaktioner omfatter dataelementet ikke den sikkerhedsstillelse, der er opkrævet af CCP'en som led i dens investeringsaktivitet. Hvis den opkrævede initialmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			samlet værdi.
21	Sikkerhedsstillelse	Initialmargin opkrævet af modpart 1 (efter haircut)	<p>Pengeværdien af den initialmargin, der er opkrævet af modpart 1, herunder eventuelle marginer, der er i transit og afventer afvikling.</p> <p>Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede initialmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede initialmargin hele porteføljen.</p> <p>Dette felt henviser til initialmarginens samlede aktuelle værdi i givet fald efter en haircut snarere end til den daglige ændring. Dataelementet vedrører både ikke-clearede og centralt clearede transaktioner. For centralt clearede transaktioner omfatter dataelementet ikke den sikkerhedsstillelse, der er opkrævet af CCP'en som led i dens investeringsaktivitet.</p> <p>Hvis den opkrævede initialmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én samlet værdi.</p>

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
22	Sikkerhedsstillelse	Valuta for den opkrævede initialmargin	Valuta, i hvilken den opkrævede initialmargin er denomineret. Hvis den opkrævede initialmargin er denomineret i mere end én valuta, afspejler dette dataelement en af de valutaer, som modpart 1 har valgt at konvertere alle værdier af opkrævede initialmarginer til.
23	Sikkerhedsstillelse	Variationsmargin opkrævet af modpart 1 (før haircut)	Pengeværdien af variationsmarginen opkrævet af modpart 1, herunder den kontant afregnede margin og en eventuel margin, der er i transit og afventer afvikling. En variationsmargin for uforudsete udgifter er ikke medtaget. Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede variationsmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede variationsmargin hele porteføljen. Dette felt henviser til den samlede aktuelle værdi af variationsmarginen, kumuleret siden den første indberetning af variationsmarginer, der er opkrævet for porteføljen eller transaktionen. Hvis den opkrævede variationsmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én samlet værdi.
24	Sikkerhedsstillelse	Variationsmargin opkrævet af modpart 1 (efter haircut)	Pengeværdien af variationsmarginen opkrævet af modpart 1, herunder den kontant afregnede margin og en eventuel margin, der er i transit og afventer afvikling. En variationsmargin for uforudsete udgifter er ikke medtaget. Hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede variationsmargin hele porteføljen, hvis sikkerhedsstillelsen foretages på porteføljeniveau, vedrører den opkrævede

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
			<p>variationsmargin hele porteføljen. Dette felt henviser til den samlede aktuelle værdi af den variationsmargin, der i givet fald er opkrævet efter en haircut, kumuleret siden den første indberetning af variationsmargin, der er opkrævet for porteføljen/transaktionen.</p> <p>Hvis den opkrævede variationsmargin er denomineret i mere end én valuta, omregnes disse beløb til en fælles valuta valgt af modpart 1 og indberettet som én samlet værdi.</p>
25	Sikkerhedsstillelse	Valuta for den opkrævede variationsmargin	<p>Valuta, i hvilken den opkrævede variationsmargin er denomineret.</p> <p>Hvis den opkrævede variationsmargin er denomineret i mere end én valuta, afspejler dette dataelement en af de valutaer, som modpart 1 har valgt at konvertere alle værdier af opkrævede variationsmargin til.</p>
26	Sikkerhedsstillelse	Overskydende sikkerhed opkrævet af modpart 1	<p>Pengeværdien af en eventuel yderligere sikkerhed opkrævet af modpart 1, og som er separat og uafhængig af initial- og variationsmargin. Dette datafelt henviser til den samlede aktuelle værdi af den overskydende sikkerhedsstillelse i givet fald inden en haircut snarere end til den daglige ændring.</p> <p>Alle opkrævede initial- eller variationsmarginbeløb, der overstiger den krævede initial- eller variationsmargin, indberettes som en del af henholdsvis den opkrævede initial- eller variationsmargin og ikke som overskydende opkrævet sikkerhed.</p> <p>For centralt clearede transaktioner indberettes overskydende sikkerhedsstillelse kun i det omfang, den kan henføres til en bestemt portefølje eller transaktion.</p>

Post	Afsnit	Felt	Oplysninger, der skal indberettes
27	Sikkerhedsstillelse	Valuta for den overskydende opkrævede sikkerhed	Valuta, i hvilken den overskydende opkrævede sikkerhed er denomineret. Hvis den overskydende sikkerhed er denomineret i mere end én valuta, afspejler dette dataelement en af de valutaer, som modpart 1 har valgt at konvertere alle værdier af den overskydende opkrævede sikkerhed til.
28	Sikkerhedsstillelse	Type handling	Indberetningen skal indeholde én af de følgende handlingstyper: a) En ny marginbalance eller en ændring af oplysninger i relation til marginerne identificeres som "ajourføring af margin" b) en korrektion af datafelter, der blev indgivet forkert i en tidligere indberetning, identificeres som "Korrektion".
29	Sikkerhedsstillelse	Dato for hændelsen	Den dato, hvor den indberetningspligtige hændelse vedrørende derivataftalen, der er omfattet af indberetningen, fandt sted. Ved ajourføring af sikkerhedsstillelse — den dato, for hvilken oplysningerne i indberetningen gives.