



Raad van de
Europese Unie

Brussel, 17 juni 2022
(OR. en)

10387/22
ADD 1

EF 179
ECOFIN 638
DELECT 98

BEGELEIDENDE NOTA

van:	de secretaris-generaal van de Europese Commissie, ondertekend door mevrouw Martine DEPREZ, directeur
aan:	het secretariaat-generaal van de Raad
nr. Comdoc.:	C(2022) 3589 final
Betreft:	BIJLAGE bij GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) .../... VAN DE COMMISSIE tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen inzake de minimale mate van gedetailleerdheid van de aan transactieregisters te rapporteren gegevens en het te gebruiken rapportagetype

Hierbij gaat voor de delegaties document C(2022) 3589 final.

Bijlage: C(2022) 3589 final



Brussel, 10.6.2022
C(2022) 3589 final

ANNEX

BIJLAGE

bij

GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) .../... VAN DE COMMISSIE

tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen inzake de minimale mate van gedetailleerdheid van de aan transactieregisters te rapporteren gegevens en het te gebruiken rapportagetype

BIJLAGE

Tabel 1

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
1	Partijen bij het derivaat	Tijdstempel van de rapportage	Datum en tijdstip van indiening van het rapport in het transactieregister.
2	Partijen bij het derivaat	Identificatie van de rapporterende entiteit	Indien de voor rapportage verantwoordelijke entiteit de indiening van het rapport aan een derde of de andere tegenpartij heeft gedelegeerd, wordt deze entiteit in dit veld geïdentificeerd aan de hand van een unieke code. Anders moet de voor rapportage verantwoordelijke entiteit in dit veld worden vermeld.
3	Partijen bij het derivaat	Voor de rapportage verantwoordelijke entiteit	Indien een financiële tegenpartij als enige verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens beide tegenpartijen overeenkomstig artikel 9, lid 1 bis, van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad ¹ en de niet-financiële tegenpartij niet besluit zelf de gegevens van haar otc-derivatencontracten met de financiële tegenpartij te rapporteren, de unieke code ter identificatie van die financiële tegenpartij. Wanneer een beheermaatschappij, in overeenstemming met artikel 9, lid 1 ter, van die verordening, verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens een instelling voor collectieve belegging in effecten (icbe), de unieke identificatiecode van die beheermaatschappij. Wanneer een beheerder van een alternatieve beleggingsinstelling (abi-beheerder), in overeenstemming met artikel 9, lid 1 quater, van die verordening, verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens een alternatieve

¹ 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).

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			beleggingsinstelling (abi), de unieke identificatiecode van die abi-beheerder. Wanneer een vergunninghoudende entiteit die verantwoordelijk is voor het beheren en handelen in naam van een instelling voor bedrijfspensioenvoorziening (IBPV), verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens die IBPV overeenkomstig artikel 9, lid 1 quinquies, van die verordening, de unieke code ter identificatie van die entiteit. Dit veld is alleen van toepassing op otc-derivaten.
4	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 1 (rapporterende tegenpartij)	Identificatiecode van de tegenpartij bij een derivatentransactie die via het desbetreffende rapport aan zijn rapportageverplichting voldoet. In het geval van een toegewezen derivatentransactie die door een fondsbeheerder namens een fonds wordt uitgevoerd, wordt het fonds als tegenpartij gerapporteerd, en niet de fondsbeheerder.
5	Partijen bij het derivaat	Aard van tegenpartij 1	Geef aan of tegenpartij 1 een centrale tegenpartij (CTP), een financiële tegenpartij of een niet-financiële tegenpartij in de zin van artikel 2, punten 1, 8 en 9, van Verordening (EU) nr. 648/2012 is, of een entiteit als bedoeld in artikel 1, lid 5, van die verordening.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
6	Partijen bij het derivaat	Ondernemingssector van tegenpartij 1	<p>Aard van de bedrijfsactiviteiten van tegenpartij 1</p> <p>Is tegenpartij 1 een financiële tegenpartij, dan bevat dit veld alle nodige in de taxonomie voor financiële tegenpartijen opgenomen codes in veld 6 van tabel 1 van de bijlage bij [PB: <i>gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>] die betrekking hebben op die tegenpartij.</p> <p>Is tegenpartij 1 een niet-financiële tegenpartij, dan bevat dit veld alle nodige in de taxonomie voor niet-financiële tegenpartijen opgenomen codes in veld 6 van tabel 1 van de bijlage bij [PB: <i>gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>] die betrekking hebben op die tegenpartij.</p> <p>Wanneer meer dan één activiteit wordt gerapporteerd, worden de codes ingevuld in volgorde van het relatieve belang van de betrokken activiteiten.</p>
7	Partijen bij het derivaat	Clearingdrempel van tegenpartij 1	<p>Informatie over de vraag of de posities van tegenpartij 1 boven de in artikel 4 bis, lid 3, of artikel 10, lid 3, van Verordening (EU) nr. 648/2012 bedoelde clearingdrempel uitkwam op de datum waarop de transactie werd gesloten.</p>
8	Partijen bij het derivaat	Identificatietype tegenpartij 2	<p>Indicator waaruit blijkt of tegenpartij 2 is geïdentificeerd aan de hand van een identificatiecode voor juridische entiteiten.</p>
9	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 2	<p>Identificatiecode van tegenpartij 2 bij een derivatentransactie</p> <p>In het geval van een toegewezen derivatentransactie die door een fondsbeheerder namens een fonds wordt uitgevoerd, wordt het fonds als tegenpartij gerapporteerd, en niet de fondsbeheerder.</p>
10	Partijen bij het derivaat	Land van tegenpartij 2	<p>Indien tegenpartij 2 een natuurlijke persoon is, de code van het land van verblijf van die persoon.</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
11	Partijen bij het derivaat	Aard van tegenpartij 2	Geef aan of tegenpartij 2 een CTP, een financiële tegenpartij of een niet-financiële tegenpartij in de zin van artikel 2, punten 1, 8 en 9, van Verordening (EU) nr. 648/2012 is, of een entiteit als bedoeld in artikel 1, lid 5, van die verordening.
12	Partijen bij het derivaat	Ondernemingssector van tegenpartij 2	Aard van de bedrijfsactiviteiten van tegenpartij 2 Is tegenpartij 2 een financiële tegenpartij, dan bevat dit veld alle nodige in de taxonomie voor financiële tegenpartijen opgenomen codes in veld 6 van tabel 1 van de bijlage bij [PB: <i>gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>] die betrekking hebben op die tegenpartij. Is tegenpartij 2 een niet-financiële tegenpartij, dan bevat dit veld alle nodige in de taxonomie voor niet-financiële tegenpartijen opgenomen codes in veld 6 van tabel 1 van de bijlage bij [PB: <i>gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>] die betrekking hebben op die tegenpartij. Wanneer meer dan één activiteit wordt gerapporteerd, worden de codes ingevuld in volgorde van het relatieve belang van de betrokken activiteiten.
13	Partijen bij het derivaat	Clearingdrempel van tegenpartij 2	Informatie over de vraag of de posities van tegenpartij 2 boven de in artikel 4 bis, lid 3, of artikel 10, lid 3, van Verordening (EU) nr. 648/2012 bedoelde clearingdrempel uitkwam op de datum waarop de transactie werd gesloten.
14	Partijen bij het derivaat	Rapportageverplichting van tegenpartij 2	Indicator die aangeeft of tegenpartij 2 rapportageplichtig is uit hoofde van Verordening (EU) nr. 648/2012, ongeacht wie verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage van die tegenpartij.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
15	Partijen bij het derivaat	Identificatie van de makelaar	Indien een makelaar optreedt als intermediair voor tegenpartij 1 zonder dat hij zelf een tegenpartij wordt, identificeert tegenpartij 1 de betrokken makelaar aan de hand van een unieke code.
16	Partijen bij het derivaat	Clearinglid	Identificatiecode van het clearinglid dat is gebruikt om een derivatentransactie bij een CTP te clearen. Dit gegevenslement is van toepassing op geclearde transacties.
17	Partijen bij het derivaat	Richting	Indicator die aangeeft of tegenpartij 1 de koper of de verkoper is, zoals bepaald op de datum waarop het derivaat werd afgesloten.
18	Partijen bij het derivaat	Richting van deel 1	Indicator die aangeeft of tegenpartij 1 de betaler of de ontvanger van deel 1 is, zoals bepaald op de datum waarop het derivaat werd afgesloten.
19	Partijen bij het derivaat	Richting van deel 2	Indicator die aangeeft of tegenpartij 1 de betaler of de ontvanger van deel 2 is, zoals bepaald op de datum waarop het derivaat werd afgesloten.
20	Partijen bij het derivaat	Rechtstreeks verband houdend met de handelsactiviteit of het beheer van kasmiddelen	Informatie over het feit of van het contract objectief kan worden aangetoond dat het rechtstreeks verband houdt met de commerciële bedrijvigheid of de activiteiten betreffende het beheer van de kasmiddelen van tegenpartij 1 als bedoeld in artikel 10, lid 3, van Verordening (EU) nr. 648/2012. Dit veld wordt alleen ingevuld indien tegenpartij 1 een niet-financiële tegenpartij is als bedoeld in artikel 2, punt 9, van Verordening (EU) nr. 648/2012.

Tabel 2

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
1	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Unieke transactie- identificatiecode (UTI)	Unieke transactie- identificatiecode als bedoeld in artikel 7 van [PB: <i>gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>].
2	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Traceernummer rapport	Wanneer een derivaat is uitgevoerd op een handelsplatform, een door het handelsplatform gegenereerd nummer dat uniek is voor die uitvoering.
3	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Eerdere UTI (voor één-op- één- en één-op-veel-relaties tussen transacties)	Unieke transactie- identificatiecode die is toegekend aan de eerdere transactie die aanleiding heeft gegeven tot de gerapporteerde transactie als gevolg van een levenscyclusgebeurtenis, met een één-op-één-relatie tussen transacties (bijvoorbeeld in het geval van verlenging, wanneer een transactie wordt beëindigd en wanneer een nieuwe transactie wordt aangemaakt) of met een één-op-veel-relatie tussen transacties (bijvoorbeeld bij clearing of als een transactie wordt opgesplitst in verschillende transacties). Dit gegevenselement is niet van toepassing bij het rapporteren van veel-op-één- en veel-op-veel-relaties tussen transacties (bijvoorbeeld in het geval van compressie).

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
4	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	UTI van de latere positie	De UTI van de positie waarin een derivaat is opgenomen. Dit veld is alleen van toepassing op de rapporten die betrekking hebben op de beëindiging van een derivaat als gevolg van de opnemings ervan in een positie.
5	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Identificatiecode van de posttransactiebepaling (PTRB)	Identificatiecode die wordt gegenereerd door de aanbieder van PTRB-diensten of de CTP die de PTRB-dienst verleent, teneinde alle derivaten die in een bepaalde PTRB-verrichting worden opgenomen en die uit die PTRB-verrichting voortvloeien, met elkaar te verbinden.
6	Afdeling 2a — Identificatiecodes en koppelingen	Identificatiecode van het pakket	Identificatiecode (bepaald door tegenpartij 1) om derivaten in hetzelfde pakket te koppelen overeenkomstig artikel 1, lid 3, derde alinea, van deze verordening. Een pakket kan rapportageplichtige en niet-rapportageplichtige transacties omvatten.
7	Afdeling 2b — Contractinformatie	Internationaal effectenidentificatienummer (ISIN)	ISIN ter identificatie van een product dat is toegelaten tot de handel of wordt verhandeld op een gereguleerde markt, een multilaterale handelsfaciliteit, een georganiseerde handelsfaciliteit of via een beleggingsonderneming

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			met systematische interne afhandeling.
8	Afdeling 2b — Contractinformatie	Unieke productidentificatiecode (UPI)	UPI ter identificatie van het product.
9	Afdeling 2b — Contractinformatie	Productclassificatie	Code voor de classificatie van financiële instrumenten met betrekking tot het instrument.
10	Afdeling 2b — Contractinformatie	Soort contract	Elk gerapporteerd contract wordt naar soort ingedeeld.
11	Afdeling 2b — Contractinformatie	Activaklasse	Elk gerapporteerd contract wordt ingedeeld aan de hand van de activaklasse waarop het is gebaseerd.
12	Afdeling 2b — Contractinformatie	Derivaat op basis van cryptoactiva	Indicator of het derivaat is gebaseerd op cryptoactiva.
13	Afdeling 2b — Contractinformatie	Soort identificatie van de onderliggende waarde	Soort identificatie van de relevante onderliggende waarde.
14	Afdeling 2b — Contractinformatie	Identificatie van de onderliggende waarde	De directe onderliggende waarde wordt geïdentificeerd aan de hand van een unieke identificatiecode voor de betrokken onderliggende waarde op basis van de soort waarde. Voor credit default swaps moet de ISIN van de referentieverplichting worden verstrekt.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
15	Afdeling 2b — Contractinformatie	Indicator van de onderliggende index	Vermelding van de onderliggende index, in voorkomend geval.
16	Afdeling 2b — Contractinformatie	Naam van de onderliggende index	De volledige naam van de onderliggende index zoals toegekend door de indexaanbieder.
17	Afdeling 2b — Contractinformatie	Code aangepaste korf	Indien de derivatentransactie gebaseerd is op een aangepaste korf, de unieke code die door de samensteller van de aangepaste korf is toegekend om de onderdelen ervan aan elkaar te koppelen.
18	Afdeling 2b — Contractinformatie	Identificatiecode van de onderdelen van de korf	In geval van aangepaste korven bestaande uit, onder meer, op een handelsplatform verhandelde financiële instrumenten worden enkel op een handelsplatform verhandelde financiële instrumenten gespecificeerd.
19	Afdeling 2b — Contractinformatie	Afwikkelingsvaluta 1	Valuta voor de afwikkeling van de transactie in contanten, in voorkomend geval. Voor producten op basis van meerdere valuta die niet worden verrekend, de afwikkelingsvaluta van deel 1. Dit gegevenselement is niet van toepassing op fysiek afgewikkelde producten (zoals fysiek afgewikkelde swaptions).

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
20	Afdeling 2b — Contractinformatie	Afwikkelingsvaluta 2	Valuta voor de afwikkeling van de transactie in contanten, in voorkomend geval. Voor producten op basis van meerdere valuta die niet worden verrekend, de afwikkelingsvaluta van deel 2. Dit gegevenselement is niet van toepassing op fysiek afgewikkelde producten (zoals fysiek afgewikkelde swaptions).
21	Afdeling 2c — Waardering	Waarderingsbedrag	Waardering van het contract tegen marktwaarde of waardering op basis van een modellenbenadering als bedoeld in artikel 4 van deze verordening. Voor een geclearde transactie moet de waardering van de CTP worden gebruikt.
22	Afdeling 2c — Waardering	Valuta van de waardering	Valuta waarin het waarderingsbedrag is uitgedrukt.
23	Afdeling 2c — Waardering	Tijdstempel van de waardering	Datum en tijdstip van de laatste waardering tegen marktwaarde, verstrekt door de CTP of berekend aan de hand van de actuele of laatst beschikbare marktprijs van de inputs.
24	Afdeling 2c — Waardering	Waarderingsmethode	Bron en methode die tegenpartij 1 gebruikt voor de waardering van de transactie. Indien ten minste één als modellenbenadering geclassificeerde

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>waarderingsinput wordt gebruikt, wordt de gehele waardering ingedeeld als waardering op basis van een modellenbenadering. Indien alleen inputs worden gebruikt die worden ingedeeld als “gebaseerd op de marktwaarde”, wordt de gehele waardering ingedeeld als “gebaseerd op de marktwaarde”.</p>
25	Afdeling 2c — Waardering	Delta	<p>De verhouding tussen de verandering in de prijs van een derivatentransactie en de verandering in de prijs van de onderliggende waarde.</p> <p>Dit veld is alleen van toepassing op opties en swaptions.</p> <p>De geactualiseerde delta wordt dagelijks gerapporteerd door financiële tegenpartijen en niet-financiële tegenpartijen als bedoeld in artikel 10 van Verordening (EU) nr. 648/2012.</p>
26	Afdeling 2d — Zekerheden	Indicator zekerhedenportefeuille	<p>Indicator die aangeeft of de zekerheden op portefeuillebasis zijn gesteld. Met “op portefeuillebasis” wordt een reeks transacties met een gezamenlijke margin (op netto- of brutobasis) bedoeld, in tegenstelling tot het scenario waarbij de margin voor elke afzonderlijke transactie wordt berekend en gestort.</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
27	Afdeling 2d — Zekerheden	Code van de zekerhedenportefeuille	Indien zekerheden worden gerapporteerd op portefeuillebasis, een door tegenpartij 1 aan de portefeuille toegekende unieke code. Dit gegevenselement is niet van toepassing indien de zekerheidsstelling op transactiebasis heeft plaatsgevonden, als er geen zekerheidsovereenkomst is of als er geen zekerheid is gesteld of ontvangen.
28	Afdeling 2e — Risicolimitering/rappor- ta- ge	Tijdstempel van de bevestiging	Datum en tijdstip van de bevestiging, als uiteengezet in artikel 12 van Gedelegeerde Verordening (EU) nr. 149/2013 van de Commissie ² . Alleen van toepassing op niet door een CTP geclarede otc-derivatencontracten
29	Afdeling 2e — Risicolimitering/rappor- ta- ge	Bevestigd	Voor nieuwe te rapporteren transacties, of de juridisch bindende voorwaarden van een otc-derivatencontract zijn gedocumenteerd en overeengekomen (bevestigd) of niet zijn gedocumenteerd en overeengekomen (niet bevestigd). Indien ze gedocumenteerd en overeengekomen zijn, of

² Gedelegeerde Verordening (EU) nr. 149/2013 van de Commissie van 19 december 2012 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen betreffende indirecte clearingregelingen, de clearingverplichting, het openbaar register, toegang tot een handelsplatform, niet-financiële tegenpartijen, risico-inperkingsstechnieken voor niet door een CTP geclarede otc-derivatencontracten (PB L 52 van 23.2.2013, blz. 11).

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>een dergelijke bevestiging is uitgevoerd:</p> <ul style="list-style-type: none"> • via een gezamenlijk(e) bevestigingsfaciliteit of -platform, of via een particulier of bilateraal elektronisch systeem (elektronisch); • via een voor de mens leesbaar schriftelijk document, zoals fax, papier of handmatig verwerkte e-mails (niet-elektronisch). <p>Alleen van toepassing op niet door een CTP geclearde otc-derivatencontracten</p>
30	Afdeling 2f — Clearing	Clearingverplichting	<p>Aangeven of het gerapporteerde contract behoort tot een klasse van otc-derivaten waarop de clearingverplichting van toepassing is verklaard en of beide partijen bij het contract op het moment van uitvoering van het contract aan de clearingverplichting zijn onderworpen op grond van Verordening (EU) nr. 648/2012.</p> <p>Alleen van toepassing op otc-derivatencontracten.</p>
31	Afdeling 2f — Clearing	Gecleard	<p>Indicator of het derivaat door een CTP is gecleard.</p>
32	Afdeling 2f — Clearing	Tijdstempel van de clearing	<p>Tijdstip en datum waarop de clearing heeft plaatsgevonden.</p> <p>Alleen van toepassing op door een CTP geclearde derivaten.</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
33	Afdeling 2f — Clearing	Centrale tegenpartij	Identificatiecode van de CTP die de transactie heeft geclarend. Dit gegevenselement is niet van toepassing als het gegevenselement “Cleared” de waarde “N” heeft (“Nee, niet centraal geclarend”).
34	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Soort raamovereenkomst	Verwijzing naar de soort raamovereenkomst op basis waarvan de tegenpartijen een derivaat hebben gesloten.
35	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ander soort raamovereenkomst	Naam van de raamovereenkomst. Dit veld alleen invullen wanneer in veld 34 in deze tabel “OTHR” (overig) is gerapporteerd.
36	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Versie raamovereenkomst	Verwijzing naar het jaar van de voor de gerapporteerde transactie relevante raamovereenkomst, in voorkomend geval.
37	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Intragroep	Aangeven of het contract is gesloten als een intragroepstransactie in de zin van artikel 3 van Verordening (EU) nr. 648/2012.
38	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	PTRB	Vermeld of het contract voortvloeit uit een PTRB-verrichting.
39	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Soort PTRB-techniek	Indicator van het type PTRB-verrichting met het oog op rapportage uit hoofde van Verordening (EU) nr. 648/2012. Portefeuillecompressie zonder derde-

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>dienstverlener: Een regeling om het risico in bestaande transactieportefeuilles te verminderen door niet-prijsvormende transacties te gebruiken, voornamelijk om het uitstaande nominale bedrag of het aantal transacties te verminderen of de voorwaarden anderszins te harmoniseren, door transacties geheel of gedeeltelijk te beëindigen en de beëindigde derivaten gewoonlijk te vervangen door nieuwe, vervangende transacties. Portefeuillecompressie met een derde-dienstverlener of CTP: Een door een dienstverlener of CTP verleende PTRB-dienst om het risico in bestaande transactieportefeuilles te verminderen door niet-prijsvormende transacties te gebruiken, voornamelijk om het uitstaande nominale bedrag of het aantal transacties te verminderen of de voorwaarden anderszins te harmoniseren, door transacties geheel of gedeeltelijk te beëindigen en de beëindigde derivaten gewoonlijk te vervangen door nieuwe, vervangende transacties. Herbalancering van de portefeuille /</p> <p>marginbeheer: Een door</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>een dienstverlener verleende PTRB-dienst om het risico in een bestaande transactieportefeuille te verminderen door nieuwe niet-prijsvormende transacties toe te voegen en waarbij geen bestaande transacties in de portefeuille worden beëindigd of vervangen en de nominale waarde wordt verhoogd in plaats van verlaagd.</p> <p>Andere PTRB-diensten met betrekking tot de portefeuille: Een door een dienstverlener verleende PTRB-dienst om het risico in bestaande transactieportefeuilles te verminderen door niet-prijsvormende transacties te gebruiken en die niet kan worden aangemerkt als portefeuillecompressie of -herbalancering.</p>
40	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Aanbieders van PTRB-diensten	Identificatiecode voor juridische entiteiten (legal identity identifier — LEI) van de PTRB-dienstverlener.
41	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Plaats van uitvoering	<p>Identificatie van het platform waar de transactie is uitgevoerd.</p> <p>De segment-MIC volgens ISO 10383 gebruiken voor transacties uitgevoerd op een handelsplatform, door een beleggingsonderneming</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>met systematische interne afhandeling of op een georganiseerd handelsplatform buiten de Unie. Indien de segment-MIC niet bestaat, de exploitant-MIC gebruiken. Gebruik de MIC-code "XOFF" voor financiële instrumenten die tot de handel zijn toegelaten, of worden verhandeld op een handelsplatform of waarvoor een verzoek om toelating werd gedaan, indien de transactie met betrekking tot dat financiële instrument niet wordt uitgevoerd op een handelsplatform, door een beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling of op een georganiseerd handelsplatform buiten de Unie, of indien een tegenpartij niet weet dat zij handelt met een tegenpartij 2 die als een beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling optreedt. Gebruik de MIC-code "XXXX" voor financiële instrumenten die niet tot de handel zijn toegelaten, of worden verhandeld op een handelsplatform, of waarvoor geen verzoek om toelating werd gedaan en die niet worden</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			verhandeld op een georganiseerd handelsplatform buiten de Unie.
42	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Tijdstempel van de uitvoering	Datum en tijdstip waarop een transactie oorspronkelijk werd uitgevoerd, waarbij een nieuwe UTI is aangemaakt. Dit gegevenselement blijft ongewijzigd gedurende de gehele levenscyclus van de UTI. Voor rapportage op positieniveau moet worden verwezen naar het tijdstip waarop de positie voor het eerst is geopend.
43	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum	Niet-aangepaste datum waarop de verplichtingen uit hoofde van de otc-derivatentransactie in werking treden, zoals vermeld in de bevestiging. Indien de ingangsdatum niet in de contractuele voorwaarden is gespecificeerd, vermelden de tegenpartijen in dit veld de datum van uitvoering van het derivaat.
44	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Vervaldatum	Niet-aangepaste datum waarop de verplichtingen uit hoofde van de derivatentransactie vervallen, zoals vermeld in de bevestiging. Vroegtijdige beëindiging is niet van invloed op dit gegevenselement.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
45	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Datum van de vroegtijdige beëindiging	Ingangsdatum van de vroegtijdige beëindiging (vervaldatum) van de gerapporteerde transactie. Dit gegevenselement is van toepassing indien de transactie vóór de vervaldatum wordt beëindigd als gevolg van een eerdere tussentijdse beslissing van een tegenpartij (of tegenpartijen).
46	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Uiterste contractuele afwikkelingsdatum	Niet-aangepaste contractuele datum waarop alle overdrachten van contanten of activa moeten plaatsvinden en waarop de tegenpartijen geen uitstaande contractuele verplichtingen meer mogen hebben ten opzichte van elkaar. Voor producten die mogelijk geen uiterste contractuele afwikkelingsdatum hebben (zoals Amerikaanse opties), heeft dit gegevenselement betrekking op de uiterlijke datum waarop de overdracht van contanten of activa zou plaatsvinden indien het product op de vervaldatum zou worden beëindigd.
47	Afdeling 2c — Gegevens over de transactie	Soort levering	Aangeven of het contract fysiek of contant is afgewikkeld.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
48	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijs	In de derivatentransactie gespecificeerde prijs, exclusief vergoedingen, belastingen of provisies. Wanneer de prijs niet bekend is wanneer een nieuwe transactie wordt gerapporteerd, wordt de prijs geactualiseerd zodra die beschikbaar komt. Voor transacties die deel uitmaken van een pakket bevat dit gegevens-element, in voorkomend geval, de prijs van de transactie van de component.
49	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijzvaluta	Valuta waarin de prijs luidt. De prijsvaluta is alleen van toepassing indien de prijs als geldbedrag wordt uitgedrukt.
	De velden 50 tot en met 52 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met prijsschema's.		
50	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Niet-aangepaste ingangsdatum van de prijs	Niet-aangepaste ingangsdatum van de prijs.
51	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Niet-aangepaste einddatum van de prijs	Niet-aangepaste einddatum van de prijs (niet van toepassing indien de niet-aangepaste einddatum van een bepaald schema samenvalt met de niet-aangepaste ingangsdatum van de volgende periode).

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
52	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijs die geldt tussen de niet-aangepaste ingangsdatum en de einddatum	Prijs die van kracht is tussen de niet-aangepaste ingangsdatum en de niet-aangepaste einddatum, die einddatum inbegrepen.
53	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Prijs van de pakkettransactie	Handelsprijs van het gehele pakket waarin de gerapporteerde derivatentransactie een component is. Dit gegevenselement is niet van toepassing indien: <ul style="list-style-type: none"> • er geen sprake is van een pakket, of • een spread wordt gebruikt voor de pakkettransactie. De prijzen en gerelateerde gegevenselementen van de transacties (prijsvaluta) die afzonderlijke componenten van het pakket vertegenwoordigen, worden gerapporteerd wanneer deze beschikbaar zijn. De pakkettransactieprijs is mogelijk niet bekend wanneer een nieuwe transactie wordt gerapporteerd, maar kan later worden bijgewerkt.
54	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Valuta van de prijs van de pakkettransactie	Valuta waarin de prijs van de pakkettransactie luidt. Dit gegevenselement is niet van toepassing indien: <ul style="list-style-type: none"> • er geen sprake is van een pakket, of • een spread wordt

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			gebruikt voor de pakkettransactie, of <ul style="list-style-type: none"> • de prijs van de pakkettransactie wordt uitgedrukt als percentage.
55	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag van deel 1	Nominaal bedrag van deel 1 als bedoeld in artikel 5 van de verordening.
56	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale valuta 1	Indien van toepassing: de valuta waarin het nominale bedrag van deel 1 luidt.
	De velden 57 tot en met 59 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor nominale bedragen.		
57	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van het nominale bedrag van deel 1	Niet-aangepaste datum waarop het bijbehorende nominale bedrag van deel 1 van kracht wordt.
58	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van het nominale bedrag van deel 1	Niet-aangepaste einddatum van het nominale bedrag van deel 1 (niet van toepassing indien de niet-aangepaste einddatum van een bepaald schema samenvalt met de niet-aangepaste ingangsdatum van de volgende periode).
59	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag dat gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 1	Nominaal bedrag van deel 1 dat van kracht wordt op de bijbehorende niet-aangepaste ingangsdatum.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
60	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Totale nominale hoeveelheid van deel 1	Totale nominale hoeveelheid van het onderliggende actief van deel 1 voor de looptijd van de transactie. Wanneer de totale nominale hoeveelheid niet bekend is wanneer een nieuwe transactie wordt gerapporteerd, wordt de totale nominale hoeveelheid geactualiseerd zodra deze beschikbaar komt.
	De velden 61 tot en met 63 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor de nominale hoeveelheid.		
61	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van de nominale hoeveelheid van deel 1	Niet-aangepaste datum waarop de bijbehorende nominale hoeveelheid van deel 1 van kracht wordt
62	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van de nominale hoeveelheid van deel 1	Niet-aangepaste einddatum van de nominale hoeveelheid van deel 1 (niet van toepassing indien de niet-aangepaste einddatum van een bepaald schema samenvalt met de niet-aangepaste ingangsdatum van de volgende periode).
63	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale hoeveelheid die gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 1	Nominale hoeveelheid van deel 1 die van kracht wordt op de bijbehorende niet-aangepaste ingangsdatum.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
64	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag van deel 2	In voorkomend geval, het nominale bedrag van deel 2 als bedoeld in artikel 5 van deze verordening.
65	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale valuta 2	Indien van toepassing: de valuta waarin het nominale bedrag van deel 2 luidt.
	De velden 66 tot en met 68 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor nominale bedragen.		
66	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van het nominale bedrag van deel 2	Niet-aangepaste datum waarop het bijbehorende nominale bedrag van deel 2 van kracht wordt.
67	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van het nominale bedrag van deel 2	Niet-aangepaste einddatum van het nominale bedrag van deel 2 (niet van toepassing indien de niet-aangepaste einddatum van een bepaald schema samenvalt met de niet-aangepaste ingangsdatum van de volgende periode).
68	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominaal bedrag dat gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 2	Nominaal bedrag van deel 2 dat van kracht wordt op de bijbehorende niet-aangepaste ingangsdatum.
69	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Totale nominale hoeveelheid van deel 2	Totale nominale hoeveelheid van het onderliggende actief van deel 2 voor de looptijd van de transactie. Wanneer de totale nominale hoeveelheid

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			niet bekend is wanneer een nieuwe transactie wordt gerapporteerd, wordt de totale nominale hoeveelheid geactualiseerd zodra deze beschikbaar komt.
	De velden 70 tot en met 72 zijn herhaalbaar en worden ingevuld in het geval van derivaten met schema's voor de nominale hoeveelheid.		
70	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ingangsdatum van de nominale hoeveelheid van deel 2	Niet-aangepaste datum waarop de bijbehorende nominale hoeveelheid van deel 2 van kracht wordt.
71	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Einddatum van de nominale hoeveelheid van deel 2	Niet-aangepaste einddatum van de nominale hoeveelheid van deel 2 (niet van toepassing indien de niet-aangepaste einddatum van een bepaald schema samenvalt met de niet-aangepaste ingangsdatum van de volgende periode).
72	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Nominale hoeveelheid die gold op de bijbehorende ingangsdatum van deel 2	Nominale hoeveelheid van deel 2 die van kracht wordt op de bijbehorende niet-aangepaste ingangsdatum.
	Het deel met de velden 73 tot en met 78 is herhaalbaar		

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
73	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Type overige betaling	Type van het bedrag van de overige betaling. De betaling van de optiepremie wordt niet opgenomen als betalingstype, aangezien optiepremies worden gerapporteerd via het specifieke gegevenselement voor dergelijke premies.
74	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Bedrag overige betaling	Betalingsbedragen met bijbehorende betalingstypen om te voldoen aan vereisten inzake de beschrijving van transacties uit verschillende activaklassen.
75	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Valuta overige betaling	Valuta waarin het bedrag van de overige betaling wordt uitgedrukt.
76	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Datum overige betaling	Niet-aangepaste datum waarop het bedrag van de overige betaling wordt betaald.
77	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Betaler overige betaling	Identificatiecode van de betaler van het bedrag van de overige betaling.
78	Afdeling 2g — Gegevens over de transactie	Ontvanger overige betaling	Identificatiecode van de ontvanger van het bedrag van de overige betaling.
79	Afdeling 2h — Rente	Vaste rente van deel 1 of coupon	Vermelding van het gehanteerde vasterentedeel 1 of de gehanteerde coupon, indien toepasselijk.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
80	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de vaste rente of coupon van deel 1	Indien van toepassing: conventie inzake dagtellingen (vaak ook wel dagtellingsdeel of dagtellingsbasis of dagtellingsmethode genoemd) die bepaalt hoe de rentebetalingen worden berekend. Hiermee wordt de jaarfractie van de berekeningsperiode berekend, waarbij het aantal dagen in de berekeningsperiode wordt gedeeld door het aantal dagen van het jaar.
81	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentieperiode van de vaste rente of coupon van deel 1	Indien van toepassing: tijdseenheid van de betalingsfrequentie, bv. dag, week, maand, jaar of looptijd van de stroom voor de vaste rente van deel 1 of de coupon.
82	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentieperiode van de vaste rente of coupon van deel 1	Indien van toepassing: aantal tijdseenheden (uitgedrukt door de betalingsfrequentieperiode) dat de frequentie van de periodieke betalingen van de vaste rente van deel 1 of de coupon bepaalt. Een transactie waarbij om de twee maanden betalingen worden verricht, wordt bijvoorbeeld weergegeven met de betalingsfrequentieperiode "MNTH" (maandelijks) en een multiplicator voor die periode van 2. Dit gegevenselement is niet van toepassing als de betalingsfrequentieperiode "ADHO" is. Indien de

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			betalingsfrequentieperiode “EXPI” is, is de multiplicator voor de betalingsfrequentie gelijk aan 1. Als de betalingsfrequentie dagelijks is, is de betalingsfrequentieperiode “DAIL” en is de multiplicator van de betalingsfrequentie gelijk aan 0.
83	Afdeling 2h — Rente	Identificatiecode van de variabele rente van deel 1	Indien van toepassing: vermelding van de gehanteerde rentetarieven die op gezette tijden worden herzien in het licht van een marktreferentietarief.
84	Afdeling 2h — Rente	Indicator van de variabele rente van deel 1	Vermelding van de rente, indien toepasselijk.
85	Afdeling 2h — Rente	Naam van de variabele rente van deel 1	De volledige naam van de rente zoals toegekend door de indexaanbieder.
86	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de variabele rente van deel 1	Indien van toepassing: conventie inzake dagtellingen (vaak ook wel dagtellingsdeel of dagtellingsbasis of dagtellingsmethode genoemd) die bepaalt hoe de rentebetalingen voor de variabele rente van deel 1 worden berekend. Hiermee wordt de jaarfractie van de berekeningsperiode berekend, waarbij het aantal dagen in de berekeningsperiode wordt gedeeld door het aantal dagen van het jaar.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
87	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentieperiode van de variabele rente van deel 1	Indien van toepassing: tijdseenheid van de betalingsfrequentie, bv. dag, week, maand, jaar of looptijd van de stroom van de variabele rente van deel 1.
88	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentieperiode van de variabele rente van deel 1	Indien van toepassing: aantal tijdseenheden (uitgedrukt door de betalingsfrequentieperiode) dat de frequentie van de periodieke betalingen van de variabele rente van deel 1 bepaalt. Een transactie waarbij om de twee maanden betalingen worden verricht, wordt bijvoorbeeld weergegeven met de betalingsfrequentieperiode “MNTM” (maandelijks) en een multiplicator voor die periode van 2. Dit gegevenselement is niet van toepassing als de betalingsfrequentieperiode “ADHO” is. Indien de betalingsfrequentieperiode “EXPI” is, is de multiplicator voor de betalingsfrequentie gelijk aan 1. Als de betalingsfrequentie dagelijks is, is de betalingsfrequentieperiode “DAIL” en is de multiplicator van de betalingsfrequentie gelijk aan 0.
89	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 1 — tijdsperiode	Tijdsperiode ter beschrijving van de referentieperiode voor het variabelerente deel 1.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
90	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 1 — multiplicator	Multiplicator van de tijdsperiode ter beschrijving van de referentieperiode voor het variabelerentedeel 1.
91	Afdeling 2h — Rente	Herzieningsfrequentieperiode van de variabele rente van deel 1	Indien van toepassing: tijdseenheid van de herzieningsfrequentie van de betalingen, bv. dag, week, maand, jaar of looptijd van de stroom van de variabele rente van deel 1.
92	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de herzieningsfrequentie van de variabele rente van deel 1	Indien van toepassing: aantal tijdseenheden (uitgedrukt door de betalingsfrequentieperiode) dat de frequentie van de periodieke herziening van de betalingen van de variabele rente van deel 1 bepaalt. Een transactie waarbij om de twee maanden betalingen worden verricht, wordt bijvoorbeeld weergegeven met de betalingsfrequentieperiode “MNTM” (maandelijks) en een multiplicator voor die periode van 2. Dit gegevenselement is niet van toepassing als de betalingsfrequentieperiode “ADHO” is. Indien de betalingsfrequentieperiode “EXPI” is, is de multiplicator voor de betalingsfrequentie gelijk aan 1. Als de betalingsfrequentie dagelijks is, is de betalingsfrequentieperiode “DAIL” en is de multiplicator van de betalingsfrequentie gelijk

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			aan 0.
93	Afdeling 2h — Rente	Spread van deel 1	Vermelding van de spread van deel 1, indien toepasselijk: voor otc-derivatentransacties met periodieke betalingen (bijvoorbeeld swaps met een vaste of variabele rente, rente-basiswaps, grondstoffenswaps), <ul style="list-style-type: none"> • de spread op de indexreferentieprijzen van het individuele variabele deel / de individuele variabele delen, indien er een spread is op een of meer variabele delen. • het verschil tussen de referentieprijzen van de twee indexen van het variabele deel.
94	Afdeling 2h — Rente	Valuta van de spread van deel 1	Indien van toepassing: de valuta waarin de spread van deel 1 luidt. Dit gegevenselement is alleen van toepassing indien de spread als geldbedrag wordt uitgedrukt.
95	Afdeling 2h — Rente	Vaste rente van deel 2	Vermelding van het gehanteerde vasterentedeel 2, indien toepasselijk.
96	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de vaste rente van deel 2	Indien van toepassing: conventie inzake dagtellingen (vaak ook wel dagtellingsdeel of

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			dagtellingsbasis of dagtellingsmethode genoemd) die bepaalt hoe de rentebetalingen worden berekend. Hiermee wordt de jaarfractie van de berekeningsperiode berekend, waarbij het aantal dagen in de berekeningsperiode wordt gedeeld door het aantal dagen van het jaar.
97	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentieperiode van de vaste rente van deel 2	Indien van toepassing: tijdseenheid van de betalingsfrequentie, bv. dag, week, maand, jaar of looptijd van de stroom voor de vaste rente van deel 2.
98	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentieperiode van de vaste rente van deel 2	Indien van toepassing: aantal tijdseenheden (uitgedrukt door de betalingsfrequentieperiode) dat de frequentie van de periodieke betalingen van de vaste rente van deel 2 bepaalt. Een transactie waarbij om de twee maanden betalingen worden verricht, wordt bijvoorbeeld weergegeven met de betalingsfrequentieperiode “MNTM” (maandelijks) en een multiplicator voor die periode van 2. Dit gegevenselement is niet van toepassing als de betalingsfrequentieperiode “ADHO” is. Indien de betalingsfrequentieperiode “EXPI” is, is de multiplicator voor de betalingsfrequentie gelijk aan 1. Als de

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			betalingsfrequentie dagelijks is, is de betalingsfrequentieperiode "DAIL" en is de multiplier van de betalingsfrequentie gelijk aan 0.
99	Afdeling 2h — Rente	Identificatiecode van de variabele rente van deel 2	Indien van toepassing: vermelding van de gehanteerde rentetarieven die op gezette tijden worden herzien in het licht van een marktreferentietarief
100	Afdeling 2h — Rente	Indicator van de variabele rente van deel 2	Vermelding van de rente, indien toepasselijk.
101	Afdeling 2h — Rente	Naam van de variabele rente van deel 2	De volledige naam van de rente zoals toegekend door de indexaanbieder.
102	Afdeling 2h — Rente	Dagtellingsconventie van de variabele rente van deel 2	Indien van toepassing: conventie inzake dagtellingen (vaak ook wel dagtellingsdeel of dagtellingsbasis of dagtellingsmethode genoemd) die bepaalt hoe de rentebetalingen voor de variabele rente van deel 2 worden berekend. Hiermee wordt de jaarfractie van de berekeningsperiode berekend, waarbij het aantal dagen in de berekeningsperiode wordt gedeeld door het aantal dagen van het jaar.
103	Afdeling 2h — Rente	Betalingsfrequentieperiode van de variabele rente van deel 2	Indien van toepassing: tijdseenheid van de betalingsfrequentie, bv. dag, week, maand, jaar of looptijd van de stroom van de variabele rente

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			van deel 2.
104	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de betalingsfrequentieperiode van de variabele rente van deel 2	Indien van toepassing: aantal tijdseenheden (uitgedrukt door de betalingsfrequentieperiode) dat de frequentie van de periodieke betalingen van de variabele rente van deel 2 bepaalt. Een transactie waarbij om de twee maanden betalingen worden verricht, wordt bijvoorbeeld weergegeven met de betalingsfrequentieperiode “MNTM” (maandelijks) en een multiplicator voor die periode van 2. Dit gegevenselement is niet van toepassing als de betalingsfrequentieperiode “ADHO” is. Indien de betalingsfrequentieperiode “EXPI” is, is de multiplicator voor de betalingsfrequentie gelijk aan 1. Als de betalingsfrequentie dagelijks is, is de betalingsfrequentieperiode “DAIL” en is de multiplicator van de betalingsfrequentie gelijk aan 0.
105	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 2 — tijdsperiode	Tijdsperiode ter beschrijving van de referentieperiode voor het variabelereudenteel 2.
106	Afdeling 2h — Rente	Referentieperiode van de variabele rente van deel 2 — multiplicator	Multiplicator van de tijdsperiode ter beschrijving van de referentieperiode voor het

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			variabelerentedeel 2.
107	Afdeling 2h — Rente	Herzieningsfrequentieperiode van de variabele rente van deel 2	Indien van toepassing: tijdseenheid van de herzieningsfrequentie van de betalingen, bv. dag, week, maand, jaar of looptijd van de stroom van de variabele rente van deel 2.
108	Afdeling 2h — Rente	Multiplicator van de herzieningsfrequentie van de variabele rente van deel 2	Indien van toepassing: aantal tijdseenheden (uitgedrukt door de betalingsfrequentieperiode) dat de frequentie van de periodieke herziening van de betalingen van de variabele rente van deel 2 bepaalt. Een transactie waarbij om de twee maanden betalingen worden verricht, wordt bijvoorbeeld weergegeven met de betalingsfrequentieperiode "MNTH" (maandelijks) en een multiplicator voor die periode van 2. Dit gegevenselement is niet van toepassing als de betalingsfrequentieperiode "ADHO" is. Indien de betalingsfrequentieperiode "EXPI" is, is de multiplicator voor de betalingsfrequentie gelijk aan 1. Als de betalingsfrequentie dagelijks is, is de betalingsfrequentieperiode "DAIL" en is de multiplicator van de betalingsfrequentie gelijk aan 0.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
109	Afdeling 2h — Rente	Spread van deel 2	Vermelding van de spread van deel 2, indien toepasselijk: voor otc-derivatentransacties met periodieke betalingen (bijvoorbeeld swaps met een vaste of variabele rente, rente-basiswaps, grondstoffenswaps), <ul style="list-style-type: none"> • de spread op de indexreferentieprijzen van het individuele variabele deel / de individuele variabele delen, indien er een spread is op een of meer variabele delen. • het verschil tussen de referentieprijzen van de twee indexen van het variabele deel.
110	Afdeling 2h — Rente	Valuta van de spread van deel 2	Indien van toepassing: de valuta waarin de spread van deel 2 luidt. Dit gegevenselement is alleen van toepassing indien de spread als geldbedrag wordt uitgedrukt.
111	Afdeling 2h — Rente	Spread van de pakkettransactie	Handelsprijs van het gehele pakket waarin de gerapporteerde derivatentransactie een component van een pakkettransactie is. De pakkettransactieprijs wanneer de prijs van het pakket wordt uitgedrukt als een spread, het verschil tussen twee referentieprijzen. Dit gegevenselement is niet van toepassing indien: <ul style="list-style-type: none"> • er geen sprake is van een pakket, of • de prijs van de

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>pakkettransactie wordt gebruikt.</p> <p>De spread en de gerelateerde gegevenselementen van de transacties (spreadvaluta) die afzonderlijke componenten van het pakket vertegenwoordigen, worden gerapporteerd wanneer deze beschikbaar zijn.</p> <p>De spread van de pakkettransactie is mogelijk niet bekend wanneer een nieuwe transactie wordt gerapporteerd, maar kan later worden bijgewerkt.</p>
112	Afdeling 2h — Rente	Valuta van de spread van de pakkettransactie	<p>Valuta waarin de spread van de pakkettransactie luidt.</p> <p>Dit gegevenselement is niet van toepassing indien:</p> <ul style="list-style-type: none"> • er geen sprake is van een pakket, of • de prijs van de pakkettransactie wordt gebruikt, of • de spread van de pakkettransactie wordt uitgedrukt als percentage of in de vorm van basispunten.
113	Afdeling 2i — Deviezen	Wisselkoers 1	<p>De in de derivatentransactie vermelde wisselkoers tussen de twee valuta die de tegenpartijen bij aanvang van de transactie zijn overeengekomen, uitgedrukt als de wisselkoers bij de</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			omrekening van de basisvaluta in de prijsvaluta.
114	Afdeling 2i — Deviezen	Termijnkoers	Termijnkoers zoals overeengekomen tussen de tegenpartijen van de contractuele overeenkomst. Deze wordt weergegeven als een prijs van de basisvaluta in de prijsvaluta.
115	Afdeling 2i — Deviezen	Wisselkoersbasis	Valutapaar en volgorde waarin de wisselkoers luidt, uitgedrukt als basisvaluta of prijsvaluta.
116	Afdeling 2j — Grondstoffen en emissierechten (Algemeen)	Basisproduct	Basisproduct zoals gespecificeerd in de classificatie van grondstoffen in tabel 4 van de bijlage bij [PB: <i>gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>].
117	Afdeling 2j — Grondstoffen en emissierechten (Algemeen)	Subproduct	Subproduct zoals gespecificeerd in de classificatie van grondstoffen in tabel 4 van de bijlage bij [PB: <i>gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>]. Dit veld moet een specifiek basisproduct bevatten.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
118	Afdeling 2j — Grondstoffen en emissierechten (Algemeen)	Verder subproduct	Verder subproduct zoals gespecificeerd in de classificatie van grondstoffen in tabel 4 van de bijlage bij [PB: gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588]. Dit veld moet een specifiek subproduct bevatten.
119	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Leveringspunt of -zone	Leveringspunt(en) van (een) marktgebied(en).
120	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Interconnectiepunt	Vermelding van de grens (grenzen) of grenspunt(en) van een transportcontract
121	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Belastingsprofiel	Identificatie van het leveringsprofiel.
	Het deel met de velden 122 tot en met 131 is herhaalbaar		
122	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Starttijd van het leveringsinterval	Starttijd van het leveringsinterval voor elk blok of elke vorm.
123	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Eindtijd van het leveringsinterval	Eindtijd van het leveringsinterval voor elk blok of elke vorm.
124	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Startdatum van de levering	Startdatum van de levering.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
125	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Einddatum van de levering	Einddatum van de levering.
126	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Duur	Duur van de leveringsperiode.
127	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Dagen van de week	De dagen van de week van de levering.
128	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Leveringscapaciteit	Het aantal eenheden dat is opgenomen in de transactie voor elk leveringsinterval vermeld in de velden 122 en 123.
129	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Eenheid van de hoeveelheid	De gebruikte maateenheid.
130	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Prijs per geleverde hoeveelheid in een tijdsinterval	Indien van toepassing, de prijs per hoeveelheid per leveringstijdsinterval.
131	Afdeling 2k — Grondstoffen en emissierechten (Energie)	Valuta van de prijs per geleverde hoeveelheid in een tijdsinterval	De valuta waarin de prijs per hoeveelheid per tijdsinterval wordt uitgedrukt.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
132	Afdeling 21 — Opties	Soort optie	<p>Aangeven of het derivatencontract een call (recht om een bepaald onderliggend actief te kopen) of een put (recht om een bepaald onderliggend actief te verkopen) is, dan wel of op het tijdstip van uitvoering van het derivatencontract niet valt uit te maken of het een call of put is.</p> <p>Bij swaptions:</p> <ul style="list-style-type: none"> — “put”, in het geval van een receiver swaption, waarbij de koper het recht heeft een swap af te sluiten als ontvanger van vaste rente; — “call”, in geval van een payer swaption, waarbij de koper het recht heeft een swap af te sluiten als betaler van vaste rente. <p>Bij caps en floors:</p> <ul style="list-style-type: none"> — “put”, in het geval van een floor; — “call”, in het geval van een cap.
133	Afdeling 21 — Opties	Aard van de optie	<p>Aangeven of de optie uitsluitend op een vaste datum mag worden uitgeoefend (Europese optie), op een reeks vooraf bepaalde data (Bermudaanse optie), dan wel op eender welk moment van de looptijd van het contract (Amerikaanse optie).</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
134	Afdeling 21 — Opties	Uitoefenprijs	<ul style="list-style-type: none"> • Voor andere opties dan valutaopties, swaptions en soortgelijke producten, de prijs waartegen de eigenaar van een optie het onderliggende actief van de optie kan kopen of verkopen. • Voor valutaopties, de wisselkoers waartegen de optie kan worden uitgeoefend, uitgedrukt als de wisselkoers bij de omrekening van de basisvaluta in de prijsvaluta. In het voorbeeld “0,9426 USD/EUR” is USD de basisvaluta en EUR de prijsvaluta; “1 USD = 0,9426 EUR”. Wanneer de uitoefenprijs niet bekend is wanneer een nieuwe transactie wordt gerapporteerd, wordt de uitoefenprijs geactualiseerd zodra deze beschikbaar komt. • Voor volatiliteits- en variantieswaps en soortgelijke producten wordt de volatiliteitsuitoefenprijs in dit gegevenselement gerapporteerd.
	De velden 135 tot en met 137 zijn herhaalbaar en moeten worden ingevuld in het geval van derivaten met uitoefenprijsschema's		
135	Afdeling 21 — Opties	Ingangsdatum van de uitoefenprijs	Niet-aangepaste ingangsdatum van de uitoefenprijs.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
136	Afdeling 21 — Opties	Einddatum van de uitoefenprijs	Niet-aangepaste einddatum van de uitoefenprijs (niet van toepassing indien de niet-aangepaste einddatum van een bepaald schema samenvalt met de niet-aangepaste ingangsdatum van de volgende periode).
137	Afdeling 21 — Opties	Uitoefenprijs die gold op de bijbehorende ingangsdatum	Uitoefenprijs die van kracht is tussen de niet-aangepaste ingangsdatum en de niet-aangepaste einddatum, die einddatum inbegrepen.
138	Afdeling 21 — Opties	Valuta/valutapaar van de uitoefenprijs	Voor aandelenopties, grondstoffenopties en soortgelijke producten, de valuta waarin de uitoefenprijs luidt. Voor valutaopties: Valutapaar en volgorde waarin de uitoefenprijs wordt uitgedrukt. Deze prijs wordt uitgedrukt als de basisvaluta afgezet tegen de prijsvaluta.
139	Afdeling 21 — Opties	Bedrag van de optiepremie	Voor opties en swaptions van alle activaklassen, het door de koper van de optie betaalde geldbedrag. Dit gegevenselement is niet van toepassing indien het instrument geen optie is of geen optionaliteit omvat.
140	Afdeling 21 — Opties	Valuta van de optiepremie	Voor opties en swaptions van alle activaklassen, de valuta waarin het bedrag van de optiepremie luidt. Dit gegevenselement is

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			niet van toepassing indien het instrument geen optie is of geen optionaliteit omvat.
141	Afdeling 2l — Opties	Datum van de betaling van de optiepremie	Niet-aangepaste datum waarop de optiepremie wordt betaald.
142	Afdeling 2i - Opties	Vervaldatum van de onderliggende waarde	In het geval van swaptions, vervaldatum van de onderliggende swap.
143	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Rangorde	Geeft de rangorde aan van de schuldtitel of de schuldkorf of de index die aan een derivaat ten grondslag ligt.
144	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Referentie-entiteit	Identificatie van de onderliggende referentie-entiteit.
145	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Serie	Het serienummer van de samenstelling van de index indien van toepassing.
146	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Versie	Een nieuwe versie van een serie wordt uitgegeven wanneer een van de onderdelen in gebreke blijft en de index opnieuw moet worden gewogen om het nieuwe aantal totale onderdelen binnen de index in aanmerking te nemen.
147	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Indexfactor	De op Nominaal (veld 55 in deze tabel) toe te passen factor om deze aan te passen aan de vorige kredietgebeurtenissen in die indexserie.

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
148	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Tranche	Aangeven of het derivatencontract in tranches is onderverdeeld.
149	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Attachment point CDS (Credit Default Swap) - index	Gedefinieerd punt waaronder de verliezen in de onderliggende portefeuille de nominale waarde van een tranche verminderen. Zo zal de nominale waarde in een tranche met een attachment point van 3 % worden verlaagd nadat zich in de portefeuille een verlies van 3 % heeft voorgedaan. Dit gegevenselement is niet van toepassing indien de transactie geen CDS-tranche betreft (index of aangepaste korf).
150	Afdeling 2m — Kredietderivaten	Detachment point CDS-index	Gedefinieerd punt waarboven de verliezen in de onderliggende portefeuille de nominale waarde van een tranche niet langer verminderen. Zo zal de nominale waarde in een tranche met een attachment point van 3 % en een detachment point van 6 % worden verlaagd nadat zich in de portefeuille een verlies van 3 % heeft voorgedaan. Bij een verlies van 6 % in de portefeuille is de nominale waarde van de tranche uitgeput. Dit gegevenselement is niet van toepassing indien de transactie geen CDS-tranche betreft (index of

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			aangepaste korf).
151	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Actietype	<ul style="list-style-type: none"> • Nieuw: Een eerste rapportage van een derivaat, op transactie- of positieniveau. • Wijzigen: Een wijziging van de voorwaarden of gegevens van een eerder gerapporteerd derivaat, op transactie- of positieniveau, maar geen correctie van een rapport. • Corrigeren: Een rapport waarin de foutieve gegevensvelden van een eerder ingediend rapport worden gecorrigeerd. • Beëindigen: De beëindiging van een bestaand derivaat op transactie- of positieniveau. • Fout: Een annulering van een verkeerd ingediend rapport ingeval het derivaat op transactie- of positieniveau nooit is gesloten of niet onderworpen was aan de rapportagevoorschriften van Verordening (EU) nr. 648/2012, maar bij vergissing aan een transactieregister is gerapporteerd, of de annulering van een dubbel rapport. • Heropenen: Heropening van een derivaat, op transactie- of positieniveau, dat met het actietype ‘Fout’ werd

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>geannuleerd of per vergissing werd beëindigd.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Waardering: Een actualisering van een waardering van een derivaat, op transactie- of positieniveau • Positiebestanddeel: Een rapport over een nieuw derivaat dat op dezelfde dag in een afzonderlijk positierapport is opgenomen.
152	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Soort gebeurtenis	<ul style="list-style-type: none"> • Transactie: Sluiting van een derivaat of heronderhandeling over de voorwaarden ervan waarbij de tegenpartij niet verandert • Instap Een gebeurtenis waarbij het derivaat geheel of gedeeltelijk wordt overgedragen aan een tegenpartij 2 (en als een nieuw derivaat wordt gerapporteerd) en het bestaande derivaat wordt beëindigd of de nominale waarde ervan wordt gewijzigd. • PTRB: Posttransactionele risicobeperking • Vroegtijdige beëindiging: Beëindiging van een derivaat, op transactie- of positieniveau • Clearing: Clearing zoals gedefinieerd in artikel 2, punt 3, van Verordening (EU) nr. 648/2012 • Uitoefening: De gehele of gedeeltelijke uitoefening van een optie of swaption door een

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>tegenpartij bij de transactie.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Toewijzing: Een toewijzing waarbij een bestaand derivaat aan verschillende tegenpartijen wordt toegewezen en wordt gerapporteerd als nieuwe derivaten met verlaagde nominale bedragen. • Kredietgebeurtenis: Alleen van toepassing op kredietderivaten. Een kredietgebeurtenis die leidt tot een wijziging van een derivaat, op transactie- of positieniveau <p>Corporate event: Een beheersdaad met betrekking tot onderliggende aandelen die de derivaten op die aandelen beïnvloedt</p> <ul style="list-style-type: none"> • Opneming in een positie: Opneming van door de centrale tegenpartij geclearde derivaten of van contracten ter verrekening van verschillen in een positie, waarbij een bestaand derivaat wordt beëindigd en ofwel een nieuwe positie wordt gecreëerd ofwel de nominale waarde van een bestaande positie wordt gewijzigd. <p>Actualisering — De actualisering van een uitstaand derivaat uitgevoerd tijdens de overgangperiode om ervoor te zorgen dat het in overeenstemming is</p>

	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			met de gewijzigde rapportagevereisten
153	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Datum gebeurtenis	Datum waarop de te rapporteren gebeurtenis met betrekking tot het derivatencontract die in de rapportage is opgenomen, heeft plaatsgevonden of, in geval van een wijziging, de datum waarop die wijziging van kracht wordt.
154	Afdeling 2n — Wijzigingen in het derivaat	Niveau	Aangeven of het rapport op transactie- of positieniveau is opgesteld. Een rapport op positieniveau kan alleen worden gebruikt als aanvulling op transactierapporten ter rapportering van posttransactionele gebeurtenissen en enkel indien de individuele transacties in verwisselbare producten door de positie zijn vervangen.

Tabel 3

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
1	Partijen bij het derivaat	Tijdstempel van de rapportage	Datum en tijdstip van indiening van het rapport in het transactieregister.

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
2	Partijen bij het derivaat	Identificatie van de rapporterende entiteit	Indien de voor rapportage verantwoordelijke entiteit de indiening van het rapport aan een derde of de andere tegenpartij heeft gedelegeerd, wordt deze entiteit in dit veld geïdentificeerd aan de hand van een unieke code. Anders moet de voor rapportage verantwoordelijke entiteit in dit veld worden vermeld.
3	Partijen bij het derivaat	Voor de rapportage verantwoordelijke entiteit	Indien een financiële tegenpartij als enige verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens beide tegenpartijen overeenkomstig artikel 9, lid 1 bis, van Verordening (EU) nr. 648/2012, en de niet-financiële tegenpartij niet besluit zelf de gegevens van haar otc-derivatencontracten met de financiële tegenpartij te rapporteren, de unieke code ter identificatie van die financiële tegenpartij. Wanneer een beheermaatschappij, in overeenstemming met artikel 9, lid 1 ter, van die verordening, verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens een instelling voor collectieve belegging in effecten (icbe), de unieke identificatiecode van die beheermaatschappij. Wanneer een beheerder van een alternatieve beleggingsinstelling (abi-beheerder), in overeenstemming met artikel 9, lid 1 quater, van die verordening, verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens een alternatieve beleggingsinstelling (abi), de unieke identificatiecode van die abi-beheerder. Wanneer een vergunninghoudende entiteit die verantwoordelijk is voor het beheren en handelen in naam van een instelling voor bedrijfspensioenvoorziening (IBPV), verantwoordelijk en wettelijk aansprakelijk is voor de rapportage namens die IBPV overeenkomstig artikel 9, lid 1 quinquies, van die verordening, de unieke code ter identificatie van die entiteit. Dit veld is alleen van toepassing op otc-

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			derivaten.
4	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 1 (rapporterende tegenpartij)	<p>Identificatiecode van de tegenpartij bij een derivatentransactie die via het desbetreffende rapport aan zijn rapportageverplichting voldoet.</p> <p>In het geval van een toegewezen derivatentransactie die door een fondsbeheerder namens een fonds wordt uitgevoerd, wordt het fonds als tegenpartij gerapporteerd, en niet de fondsbeheerder.</p>
5	Partijen bij het derivaat	Identificatietype tegenpartij 2	Indicator waaruit blijkt of tegenpartij 2 is geïdentificeerd aan de hand van een identificatiecode voor juridische entiteiten.
6	Partijen bij het derivaat	Tegenpartij 2	<p>Identificatiecode van tegenpartij 2 bij een derivatentransactie</p> <p>In het geval van een toegewezen derivatentransactie die door een fondsbeheerder namens een fonds wordt uitgevoerd, wordt het fonds als tegenpartij gerapporteerd, en niet de fondsbeheerder.</p>
7	Zekerheden	Tijdstempel van de zekerheden	Datum en tijdstip waarop de waarden van de margins worden gerapporteerd.

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
8	Zekerheden	Indicator zekerhedenportefeuille	Indicator die aangeeft of de zekerheden op portefeuillebasis zijn gesteld. Met “op portefeuillebasis” wordt een reeks transacties met een gezamenlijke margin (op netto- of brutobasis) bedoeld, in tegenstelling tot het scenario waarbij de margin voor elke afzonderlijke transactie wordt berekend en gestort.
9	Zekerheden	Code van de zekerhedenportefeuille	Indien zekerheden worden gerapporteerd op portefeuillebasis, een door tegenpartij 1 aan de portefeuille toegekende unieke code. Dit gegevenslement is niet van toepassing indien de zekerheidsstelling op transactiebasis heeft plaatsgevonden, als er geen zekerheidsovereenkomst is of als er geen zekerheid is gesteld of ontvangen.
10	Zekerheden	UTI	Unieke transactie-identificatiecode als bedoeld in artikel 7 van [<i>PB: gelieve verwijzing in te voegen naar C(2022) 3588</i>].
11	Zekerheden	Categorie zekerheidsstelling	Geef aan of er een zekerheidsovereenkomst tussen de tegenpartijen is. Dit gegevenslement wordt verstrekt voor elke transactie of portefeuille, afhankelijk van de vraag of de zekerheidsstelling wordt verricht op transactie- of portefeuilleniveau, en is van toepassing op zowel geclearde als niet-geclearde transacties.

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
12	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte initial margin (vóór de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 gestorte initial margin, met inbegrip van eventuele margin die nog onderweg is en nog moet worden afgewikkeld.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de gestorte initial margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de gestorte initial margin betrekking op die afzonderlijke transacties.</p> <p>Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de initial margin, en niet op de dagelijkse verandering ervan.</p> <p>Het gegevens-element heeft betrekking op zowel niet-geclearde als centraal geclearde transacties.</p> <p>Voor centraal geclearde transacties omvat het gegevens-element niet de bijdragen aan het wanbetalingsfonds, noch de zekerheden die tegen liquiditeitsvoorzieningen bij de centrale tegenpartij zijn gestort, d.w.z. vastgelegde kredietlijnen.</p> <p>Indien de gestorte initial margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1 gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.</p>
13	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte initial margin (na de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 gestorte initial margin, met inbegrip van eventuele margin die nog onderweg is en nog moet worden afgewikkeld.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de gestorte initial margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de gestorte initial margin betrekking op die afzonderlijke transacties.</p> <p>Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de initial margin na toepassing van de haircut (in voorkomend geval), en niet op de dagelijkse verandering ervan.</p>

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>Het gegevenselement heeft betrekking op zowel niet-geclearde als centraal geclearde transacties. Voor centraal geclearde transacties omvat het gegevenselement niet de bijdragen aan het wanbetalingsfonds, noch de zekerheden die tegen liquiditeitsvoorzieningen bij de centrale tegenpartij zijn gestort, d.w.z. vastgelegde kredietlijnen.</p> <p>Indien de gestorte initial margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1 gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.</p>
14	Zekerheden	Valuta van de gestorte initial margin	<p>Valuta waarin de gestorte initial margin luidt. Indien de gestorte initial margin luidt in meer dan één valuta, geeft dit gegevenselement één van die valuta weer die tegenpartij 1 heeft gekozen voor de omrekening van alle waarden van de gestorte initial margin.</p>
15	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte variation margin (vóór de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 gestorte variation margin, met inbegrip van de in contanten afgewikkelde margin en eventuele margin die nog onderweg is en nog niet is afgewikkeld.</p> <p>De voorwaardelijke variation margin is niet inbegrepen.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de gestorte variation margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de gestorte variation margin betrekking op die afzonderlijke transacties. Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de variation margin, die is gecumuleerd sinds de eerste rapportage van de voor de portefeuille of transactie gestorte variation margins.</p> <p>Indien de gestorte variation margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1</p>

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.
16	Zekerheden	Door tegenpartij 1 gestorte variation margin (na de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 gestorte variation margin, met inbegrip van de in contanten afgewikkelde margin en eventuele margin die nog onderweg is en nog niet is afgewikkeld.</p> <p>De voorwaardelijke variation margin is niet inbegrepen.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de gestorte variation margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de gestorte variation margin betrekking op die afzonderlijke transacties.</p> <p>Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de variation margin na toepassing van de haircut, in voorkomend geval, die is gecumuleerd sinds de eerste rapportage van de voor de portefeuille of transactie gestorte variation margin.</p> <p>Indien de gestorte variation margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1 gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.</p>

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
17	Zekerheden	Valuta van de gestorte variation margins	<p>Valuta waarin de gestorte variation margin luidt.</p> <p>Indien de gestorte variation margin luidt in meer dan één valuta, geeft dit gegevenslement één van die valuta weer die tegenpartij 1 heeft gekozen voor de omrekening van alle waarden van de gestorte variation margin.</p>
18	Zekerheden	Door tegenpartij 1 te veel gestorte zekerheden	<p>Monetaire waarde van eventuele aanvullende zekerheden die afzonderlijk en onafhankelijk van de initial en de variation margin zijn gestort door tegenpartij 1. Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de te veel gestorte zekerheden vóór toepassing van de haircut (in voorkomend geval), en niet op de dagelijkse verandering ervan.</p> <p>Elke gestorte initial of variation margin die de vereiste initial of variation margin overschrijdt, wordt gerapporteerd als onderdeel van respectievelijk de gestorte initial margin of de gestorte variation margin, en wordt niet opgenomen in de te veel gestorte zekerheden.</p> <p>Voor centraal geclearde transacties worden te veel gestorte zekerheden alleen gerapporteerd voor zover die aan een specifieke portefeuille of transactie kunnen worden toegewezen.</p>
19	Zekerheden	Valuta van de te veel gestorte zekerheden	<p>Valuta waarin de te veel gestorte zekerheden luiden.</p> <p>Indien de te veel gestorte zekerheden luiden in meer dan één valuta, geeft dit gegevenslement één van die valuta weer die tegenpartij 1 heeft gekozen voor de omrekening van alle waarden van de te veel gestorte zekerheden.</p>

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
20	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde initial margin (vóór de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 geïnde initial margin, met inbegrip van eventuele margin die nog onderweg is en nog moet worden afgewikkeld.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de geïnde initial margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de geïnde initial margin betrekking op die afzonderlijke transacties.</p> <p>Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de initial margin, en niet op de dagelijkse verandering ervan.</p> <p>Het gegevenselement heeft betrekking op zowel niet-geclearde als centraal geclearde transacties. Voor centraal geclearde transacties omvat het gegevenselement niet de zekerheden die de centrale tegenpartij heeft geïnd in het kader van haar beleggingsactiviteit.</p> <p>Indien de geïnde initial margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1 gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.</p>
21	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde initial margin (na de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 geïnde initial margin, met inbegrip van eventuele margin die nog onderweg is en nog moet worden afgewikkeld.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de geïnde initial margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de geïnde initial margin betrekking op die afzonderlijke transacties.</p> <p>Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de initial margin na toepassing van de haircut (in voorkomend geval), en niet op de dagelijkse verandering ervan.</p> <p>Het gegevenselement heeft betrekking op zowel niet-geclearde als centraal geclearde</p>

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			<p>transacties. Voor centraal geclearde transacties omvat het gegevenselement niet de zekerheden die de centrale tegenpartij heeft geïnd in het kader van haar beleggingsactiviteit.</p> <p>Indien de geïnde initial margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1 gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.</p>
22	Zekerheden	Valuta van de geïnde initial margin	<p>Valuta waarin de geïnde initial margin luidt. Indien de geïnde initial margin luidt in meer dan één valuta, geeft dit gegevenselement één van die valuta weer die tegenpartij 1 heeft gekozen voor de omrekening van alle waarden van de geïnde initial margin.</p>
23	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde variation margin (vóór de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 geïnde variation margin, met inbegrip van de in contanten afgewikkelde margin en eventuele margin die nog onderweg is en nog niet is afgewikkeld.</p> <p>De voorwaardelijke variation margin is niet inbegrepen.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de geïnde variation margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de geïnde variation margin betrekking op die afzonderlijke transacties.</p> <p>Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de variation margin, die is gecumuleerd sinds de eerste rapportage van de voor de portefeuille of transactie geïnde variation margins.</p> <p>Indien de geïnde variation margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1</p>

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.
24	Zekerheden	Door tegenpartij 1 geïnde variation margin (na de haircut)	<p>Monetaire waarde van de door tegenpartij 1 geïnde variation margin, met inbegrip van de in contanten afgewikkelde margin en eventuele margin die nog onderweg is en nog niet is afgewikkeld.</p> <p>De voorwaardelijke variation margin is niet inbegrepen.</p> <p>Indien de zekerheidsstelling op portefeuilleniveau geschiedt, heeft de geïnde variation margin betrekking op de gehele portefeuille; indien de zekerheidsstelling geschiedt op het niveau van afzonderlijke transacties, heeft de geïnde variation margin betrekking op die afzonderlijke transacties.</p> <p>Dit veld heeft betrekking op de totale actuele waarde van de geïnde variation margin na toepassing van de haircut, in voorkomend geval, die is gecumuleerd sinds de eerste rapportage van de voor de portefeuille/transactie geïnde variation margin.</p> <p>Indien de geïnde variation margin luidt in meer dan één valuta, worden die bedragen omgerekend in één enkele door tegenpartij 1 gekozen valuta en gerapporteerd als één totale waarde.</p>

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
25	Zekerheden	Valuta van de geïnde variation margin	Valuta waarin de geïnde variation margin luidt. Indien de geïnde variation margin luidt in meer dan één valuta, geeft dit gegevenslement één van die valuta weer die tegenpartij 1 heeft gekozen voor de omrekening van alle waarden van de geïnde variation margin.
26	Zekerheden	Door tegenpartij 1 te veel geïnde zekerheden	Monetaire waarde van eventuele aanvullende zekerheden die afzonderlijk en onafhankelijk van de initial en de variation margin zijn geïnd door tegenpartij 1. Dit gegevenslement heeft betrekking op de totale actuele waarde van de te veel geïnde zekerheden vóór toepassing van de haircut (in voorkomend geval), en niet op de dagelijkse verandering ervan. Elke geïnde initial of variation margin die de vereiste initial of variation margin overschrijdt, wordt gerapporteerd als onderdeel van respectievelijk de geïnde initial margin of de geïnde variation margin, en wordt niet opgenomen in de te veel geïnde zekerheden. Voor centraal geclearde transacties worden te veel geïnde zekerheden alleen gerapporteerd voor zover die aan een specifieke portefeuille of transactie kunnen worden toegewezen.
27	Zekerheden	Valuta van de te veel geïnde zekerheden.	Valuta waarin de te veel geïnde zekerheden luiden. Indien de te veel geïnde zekerheden luiden in meer dan één valuta, geeft dit gegevenslement één van die valuta weer die tegenpartij 1 heeft gekozen voor de omrekening van alle waarden van de te veel geïnde zekerheden.
28	Zekerheden	Actietype	De rapportage bevat één van de volgende actietypes: a) een nieuw marginalsaldo of een wijziging van de gegevens van de margins wordt als “Actualisering van de margin”

Post	Afdeling	Veld	Te melden gegevens
			geïdentificeerd; b) een correctie van gegevensvelden die in een voorgaande rapportage verkeerd zijn ingevuld, wordt als “Correctie” geïdentificeerd.
29	Zekerheden	Datum gebeurtenis	Datum waarop de te rapporteren gebeurtenis met betrekking tot het derivatencontract die in de rapportage is opgenomen, heeft plaatsgevonden. In het geval van actualisering van zekerheden: de datum waarop de in het rapport opgenomen informatie wordt verstrekt.