



Europeiska  
unionens råd

Bryssel den 17 juni 2022  
(OR. en)

10387/22  
ADD 1

EF 179  
ECOFIN 638  
DELECT 98

## FÖLJENOT

---

från:	Europeiska kommissionens generalsekreterare, undertecknat av Martine DEPREZ, direktör
till:	Rådets generalsekretariat
Komm. dok. nr:	C(2022) 3589 final
Ärende:	BILAGA till KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) .../... om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 648/2012 vad gäller tekniska tillsynsstandarder som specificerar vilka uppgifter som minst ska rapporteras till transaktionsregister och vilken typ av rapporter som ska användas

---

För delegationerna bifogas dokument – C(2022) 3589 final.

Bilaga: C(2022) 3589 final



EUROPEISKA  
KOMMISSIONEN

Bryssel den 10.6.2022  
C(2022) 3589 final

ANNEX

## **BILAGA**

**til**

### **KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) .../...**

**om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 648/2012 vad gäller tekniska tillsynsstandarder som specificerar vilka uppgifter som minst ska rapporteras till transaktionsregister och vilken typ av rapporter som ska användas**

## **BILAGA**

Tabell 1

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
1	Parter i derivatet	Rapporteringstillfälle	Datum och klockslag för inlämning av rapport till transaktionsregistret.
2	Parter i derivatet	Rapportinlämnande enhets ID	Om den enhet som ansvarar för rapporteringen har delegerat inlämnandet av rapporten till en tredje part eller till den andra motparten ska den enheten identifieras i detta fält med en unik kod. I annat fall bör den enhet som ansvarar för rapporteringen anges i detta fält.
3	Parter i derivatet	Enhet som ansvarar för rapporteringen	Om en finansiell motpart är ensamt ansvarig, även juridiskt sett, för rapportering för båda motparternas räkning i enlighet med artikel 9.1a i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 <sup>1</sup> och den icke-finansiella motparten inte beslutar att själv rapportera uppgifterna om sina OTC-derivatkontrakt med den finansiella motparten: den finansiella motpartens unika identifieringskod. Om ett förvaltningsbolag är ansvarigt, även juridiskt sett, för rapporteringen på vägnar av ett företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag) i enlighet med artikel 9.1b i samma förordning: förvaltningsbolagets unika identifieringskod. Om en förvaltare av alternativa investeringsfonder (AIF-förvaltare) är ansvarig, även juridiskt sett, för rapporteringen på en alternativ investeringsfonds vägnar i enlighet med artikel 9.1c i den förordningen: AIF-förvaltarens unika identifieringskod. Om en auktoriserad enhet som är ansvarig för att förvalta ett tjänstepensionsinstitut och agera å dess vägnar är ansvarig, även juridiskt sett, för att för dess räkning rapportera i enlighet med artikel

<sup>1</sup> Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 av den 4 juli 2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister (EUT L 201, 27.7.2012, s. 1).

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			9.1d i den förordningen: den enhetens unika identifieringskod. Detta fält gäller endast OTC-derivat.
4	Parter i derivatet	Motpart 1 (rapporterande motpart)	Identifieringskod för den motpart i en derivattransaktion som fullgör sin rapporteringsskyldighet via rapporten i fråga. När det gäller en allokerad derivattransaktion som utförs av en fondförvaltare för en fonds räkning rapporteras fonden och inte fondförvaltaren som motpart.
5	Parter i derivatet	Typ av motpart 1	Ange om motpart 1 är en central motpart, en finansiell motpart eller en icke-finansiell motpart enligt definitionen i artikel 2.1, 2.8 och 2.9 i förordning (EU) nr 648/2012, eller en enhet som avses i artikel 1.5 i den förordningen.
6	Parter i derivatet	Bransch för motpart 1	Typ av verksamhet för motpart 1. Om motpart 1 är en finansiell motpart ska detta fält innehålla alla nödvändiga koder som ingår i taxonomin för finansiella motparter i fält 6 i tabell 1 i bilagan till [ <i>Publikationsbyrå: infoga hänvisning till C(2022) 3588</i> ] och som gäller för den motparten. Om motpart 1 är en icke-finansiell motpart ska detta fält innehålla alla nödvändiga koder som ingår i taxonomin för icke-finansiella motparter i fält 6 i tabell 1 i bilagan till [ <i>Publikationsbyrå: infoga hänvisning till C(2022) 3588</i> ] och som gäller för den motparten. Om mer än en verksamhet rapporteras ska koderna anges i prioritetsordning efter verksamheternas relativa betydelse.
7	Parter i derivatet	Clearingtröskel för motpart 1	Information om huruvida motpart 1 överskrider den clearingtröskel som avses i artikel 4a.3 eller artikel 10.3 i förordning (EU) nr 648/2012 vid den tidpunkt då transaktionen slutfördes.

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
8	Parter i derivatet	Typ av identifieringskod för motpart 2	Indikator för huruvida LEI-koden användes för att identifiera motpart 2.
9	Parter i derivatet	Motpart 2	Identifieringskod för den andra motparten i en derivattransaktion. När det gäller en allokerad derivattransaktion som utförs av en fondförvaltare för en fonds räkning rapporteras fonden och inte fondförvaltaren som motpart.
10	Parter i derivatet	Land för motpart 2	Om motpart 2 är en fysisk person, koden för den personens hemvistland.
11	Parter i derivatet	Typ av motpart 2	Ange om motpart 2 är en central motpart, en finansiell motpart eller en icke-finansiell motpart enligt definitionen i artikel 2.1, 2.8 och 2.9 i förordning (EU) nr 648/2012, eller en enhet som avses i artikel 1.5 i den förordningen.
12	Parter i derivatet	Bransch för motpart 2	Typ av verksamhet för motpart 2. Om motpart 2 är en finansiell motpart ska detta fält innehålla alla nödvändiga koder som ingår i taxonomin för finansiella motparter i fält 6 i tabell 1 i bilagan till [ <i>Publikationsbyrån: infoga hänvisning till C(2022) 3588</i> ] och som gäller för den motparten. Om motpart 2 är en icke-finansiell motpart ska detta fält innehålla alla nödvändiga koder som ingår i taxonomin för icke-finansiella motparter i fält 6 i tabell 1 i bilagan till [ <i>Publikationsbyrån: infoga hänvisning till C(2022) 3588</i> ] och som gäller för den motparten. Om mer än en verksamhet rapporteras ska koderna anges i prioritetsordning efter verksamheternas relativa betydelse.
13	Parter i derivatet	Clearingtröskel för motpart 2	Information om huruvida motpart 2 överskrider den clearingtröskel som avses i artikel 4a.3 eller artikel 10.3 i förordning (EU) nr 648/2012 vid den tidpunkt då transaktionen slutfördes.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
14	Parter i derivatet	Rapporteringskyldighet för motpart 2	Indikator för huruvida motpart 2 är rapporteringskyldig enligt förordning (EU) nr 648/2012, oavsett vem som är ansvarig, även juridiskt sett, för rapporteringen.
15	Parter i derivatet	Mäklar-ID	Om en mäklare fungerar som mellanhand för motpart 1 men utan att själv bli motpart, ska motpart 1 ange mäklaren med en unik kod.
16	Parter i derivatet	Clearingmedlem	Identifieringskod för den clearingmedlem genom vilken en derivattransaktion clearades hos en central motpart. Detta dataelement är tillämpligt på clearade transaktioner.
17	Parter i derivatet	Riktning	Uppgift om huruvida motpart 1 var köparen eller säljaren vid den tidpunkt då derivatet ingicks.
18	Parter i derivatet	Riktning för del 1	Uppgift om huruvida motpart 1 är betalaren eller mottagaren av del 1, fastställt den dag då derivatet ingicks.
19	Parter i derivatet	Riktning för del 2	Uppgift om huruvida motpart 1 är betalaren eller mottagaren av del 2, fastställt den dag då derivatet ingicks.
20	Parter i derivatet	Direkt kopplat till affärsverksamhet eller likviditetsförvaltning	Information om huruvida kontraktet på ett objektivet mätbart sätt är direkt kopplat till motpart 1:s affärsverksamhet eller likviditetsförvaltning, i enlighet med vad som anges i artikel 10.3 i förordning (EU) nr 648/2012. Detta fält ska endast fyllas i om motpart 1 är en icke-finansiell motpart i den mening som avses i artikel 2.9 i förordning (EU) nr 648/2012.

Tabell 2

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
1	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	UTI-kod	Unik transaktionskod enligt artikel 7 i [ <i>Publikationsbyrå: infoga hänvisning till C(2022) 3588</i> ].
2	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	Rapportens spårningsnummer	Om ett derivat handlades på en handelsplats, ett nummer som genererats av handelsplatsen och som är unikt för denna handel.
3	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	Tidigare UTI-kod (för en-till-en-relationer och en-till-många-relationer mellan transaktioner)	UTI-kod som tilldelats den föregående transaktion som gett upphov till den rapporterade transaktionen på grund av en livscykelhändelse, i en en-till-en-relation mellan transaktioner (t.ex. vid novation, när en transaktion avslutas och en ny transaktion genereras) eller i ett förhållande mellan transaktioner (t.ex. vid clearing eller om en transaktion delas upp i flera olika transaktioner). Detta dataelement är inte tillämpligt vid rapportering av många-till-en- och många-till-många-relationer mellan transaktioner (t.ex. vid kompression).
4	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	UTI-kod för efterföljande position	UTI-koden för den position i vilken ett derivat ingår. Detta fält är endast tillämpligt för rapporter om avslutande av ett derivat på grund av att det ingår i en position.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
5	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	ID för riskreduceringstjänst efter handel (PTRR)	Identifieringskod som genererats av den leverantör av riskreduceringstjänster efter handel eller den centrala motpart som tillhandahåller tjänsten för att koppla samman alla derivat som ingår i en viss riskreduceringsåtgärd och som är ett resultat av denna åtgärd.
6	Avsnitt 2a – Identifieringskoder och kopplingar	Paketets identifieringskod	Identifieringskod (fastställd av motpart 1) för att koppla samman derivat i samma paket i enlighet med artikel 1.3 tredje stycket i denna förordning. Ett paket kan innehålla både rapporteringspliktiga och icke rapporteringspliktiga transaktioner.
7	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Internationellt standardnummer för värdepapper (ISIN)	ISIN-kod som identifierar produkten om den produkten är upptagen till handel eller handlas på en reglerad marknad, MTF-plattform, OTF-plattform eller via en systematisk internhandlare.
8	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Unik produktbeteckning (UPI-kod)	UPI-kod som identifierar produkten.
9	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Produktklassificering	Kod för klassificering av finansiella instrument (CFI-kod) för instrumentet.
10	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Typ av kontrakt	Varje rapporterat kontrakt ska klassificeras efter typ.
11	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Tillgångsklass	Varje rapporterat kontrakt ska klassificeras efter den tillgångsklass som det

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			baseras på.
12	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Derivat baserade på kryptotillgångar	Indikator på huruvida derivatet är baserat på kryptotillgångar.
13	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Typ av identifiering av det underliggande	Typen av identifiering av det underliggande
14	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Identifiering av det underliggande	Den direkt underliggande tillgången ska identifieras med hjälp av ett unikt ID baserat på typ. Vid creditswappar ska ISIN-koden för referensfordran anges.
15	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Uppgift om underliggande index	Uppgift om det underliggande indexet, i förekommande fall.
16	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Namn på underliggande index	Det underliggande indexets fullständiga namn som bestämts av indexleverantören.
17	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Anpassad korgkod	Om derivattransaktionen baseras på en anpassad korg, en unik kod som tilldelats av den anpassade korgens strukturerare för att koppla samman dess beståndsdelar.
18	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Identifieringskod för korgens beståndsdelar	För anpassade korgar där det bland annat ingår finansiella instrument som handlas på en handelsplats ska endast dessa finansiella instrument som handlas på en handelsplats anges.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
19	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Avvecklingsvaluta 1	Valuta för kontantavveckling av transaktionen i förekommande fall. För produkter med flera valutor som inte nettas, avvecklingsvalutan för del 1. Detta dataelement är inte tillämpligt för fysiskt avvecklade produkter (t.ex. fysiskt avvecklade swaptioner).
20	Avsnitt 2b – uppgifter om kontraktet	Avvecklingsvaluta 2	Valuta för kontantavveckling av transaktionen i förekommande fall. För produkter med flera valutor som inte nettas, avvecklingsvalutan för del 2. Detta dataelement är inte tillämpligt för fysiskt avvecklade produkter (t.ex. fysiskt avvecklade swaptioner).
21	Avsnitt 2c – värdering	Värderingsbelopp	Marknadsvärdering av kontraktet eller modellvärdering enligt artikel 4 i denna förordning. Den centrala motpartens värdering ska användas för en clearad transaktion.
22	Avsnitt 2c – värdering	Värderingsvaluta	Valuta som värderingsbeloppet är denominerat i.
23	Avsnitt 2c – värdering	Tidsangivelse för värdering	Datum och tidpunkt för den senaste marknadsvärderade värderingen, som tillhandahålls av den centrala motparten eller beräknas med hjälp av det aktuella eller senast

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			tillgängliga marknadspriset i indata.
24	Avsnitt 2c – värdering	Värderingsmetod	<p>Källa och metod som används för motpart 1:s värdering av transaktionen.</p> <p>Om minst en värderingsindata används som klassificeras som modellvärdering klassificeras hela värderingen som modellvärdering.</p> <p>Om endast indata som klassificeras som marknadsvärdering används, klassificeras hela värderingen som marknadsvärdering.</p>
25	Avsnitt 2c – värdering	Delta	<p>Förhållandet mellan förändringen i priset på en derivattransaktion och förändringen i priset på det underliggande.</p> <p>Detta fält gäller endast optioner och swaptioner. Uppdaterade deltauppgifter ska rapporteras dagligen av finansiella motparter och icke-finansiella motparter i enlighet med artikel 10 i förordning (EU) nr 648/2012.</p>
26	Avsnitt 2d – säkerhet	Indikator för portföljsäkerhet	<p>Indikator för om säkerheten ställts på portföljbasis. Med ”på portföljbasis” avses en uppsättning transaktioner för vilka marginalsäkerheten ställs tillsammans (antingen netto eller brutto), i motsats till ett scenario där marginalsäkerheten beräknas och bokförs separat för varje enskild</p>

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			transaktion.
27	Avsnitt 2d – säkerhet	Kod för portföljsäkerhet	Om säkerheter rapporteras på portföljbasis, den unika kod som motpart 1 har tilldelat portföljen. Detta dataelement är inte tillämpligt om säkerheten ställts på transaktionsnivå eller om det inte finns något säkerhetsavtal eller om inga säkerheter ställs eller tas emot.
28	Avsnitt 2e – riskreducering/riskrapportering	Bekräftelsetillfälle	Datum och tidpunkt för bekräftelsen i enlighet med artikel 12 i kommissionens delegerade förordning (EU) nr 149/2013 <sup>2</sup> . Endast tillämpligt för OTC-derivatkontrakt som inte clearas via en central motpart
29	Avsnitt 2e – riskreducering/riskrapportering	Bekräftat	För nya rapporteringspliktiga transaktioner, huruvida de rättsligt bindande villkoren i ett OTC-derivatavtal dokumenterades och avtalades (bekräftades) eller inte (ej bekräftades). Om de dokumenterades och avtalades, om en sådan bekräftelse har gjorts <ul style="list-style-type: none"> <li>• via en gemensam bekräftelsemekanism eller bekräftelseplattform, eller ett privat eller bilateralt</li> </ul>

<sup>2</sup> Kommissionens delegerade förordning (EU) nr 149/2013 av den 19 december 2012 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 med avseende på tekniska standarder för tillsyn av indirekta clearingarrangemang, clearingkravet, det offentliga registret, tillträde till en handelsplats, icke-finansiella motparter och riskbegränsningstekniker för OTC-derivatkontrakt som inte clearas via en central motpart (EUT L 052, 23.2.2013, s. 11).

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			elektroniskt system (elektroniskt), <ul style="list-style-type: none"> <li>• via ett skriftligt dokument som kan läsas av människor, t.ex. fax, papper eller manuellt bearbetade e-postmeddelanden (icke-elektroniskt).</li> </ul> Endast tillämpligt för OTC-derivatkontrakt som inte clearas via en central motpart
30	Avsnitt 2f – clearing	Clearingkravet	Ange om det rapporterade kontraktet tillhör en klass av OTC-derivat som förklarats vara föremål för kravet på clearing och båda motparterna till kontraktet omfattas av kravet på clearing enligt förordning (EU) nr 648/2012 från och med tidpunkten för genomförandet av kontraktet. Endast tillämpligt för OTC-derivatkontrakt.
31	Avsnitt 2f – clearing	Clearat	Uppgift om huruvida derivatet har clearats av en central motpart.
32	Avsnitt 2f – clearing	Clearingtillfälle	Tidpunkt och dag när clearingen ägde rum. Endast tillämpligt för derivat som clearas av en central motpart.
33	Avsnitt 2f – clearing	Central motpart	Identifieringskod för den centrala motpart som clearade transaktionen. Detta dataelement är inte tillämpligt om värdet för dataelementet ”Clearat” är ”N” (”Nej, har inte clearats centralt”).

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
34	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ramavtalstyp	Hänvisning till den typ av ramavtal enligt vilken motparterna ingick ett derivat.
35	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan ramavtalstyp	Namn på ramavtalet. Detta fält ska endast fyllas i om ”OTHR” anges i fält 34 i denna tabell.
36	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ramavtalsversion	Uppgift om årsversionen av det ramavtal som är relevant för den rapporterade transaktionen, om tillämpligt.
37	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Inom gruppen	Anger om kontraktet ingicks som en transaktion inom gruppen enligt artikel 3 i förordning (EU) nr 648/2012.
38	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Riskreduceringstjänst efter handel	Anger om kontraktet är ett resultat av en riskreduceringstjänst efter handel.
39	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Typ av teknik för riskreduceringstjänst efter handel	Uppgift om typ av riskreduceringstjänst efter handel för rapportering enligt förordning (EU) nr 648/2012. Portföljkompression utan tredjepartsleverantör: Ett arrangemang för att minska risken i befintliga handelsportföljer som använder icke-prisbildande transaktioner främst för att minska det teoretiska utestående beloppet, antalet transaktioner eller på annat sätt harmonisera villkoren, genom att helt eller delvis avsluta transaktionerna och i allmänhet ersätta de

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>avslutade derivaten med nya ersättningstransaktioner.</p> <p>Portföljkompression med en tredjepartsleverantör eller central motpart: En riskreduceringstjänst efter handel som tillhandahålls av en tjänsteleverantör eller central motpart för att minska risken i befintliga handelsportföljer som använder icke-prisbildande transaktioner främst för att minska det teoretiska utestående beloppet, antalet transaktioner eller på annat sätt harmonisera villkoren, genom att helt eller delvis avsluta transaktionerna och i allmänhet ersätta de avslutade derivaten med nya ersättningstransaktioner.</p> <p>Portföljomsördelning/förvaltning av marginalsäkerhet: En riskreduceringstjänst efter handel som tillhandahålls av en tjänsteleverantör för att minska risken i en befintlig handelsportfölj genom att lägga till nya transaktioner som inte är prisbildande och där inga befintliga transaktioner i portföljen avslutas eller ersätts och det teoretiska värdet ökas snarare än minskas.</p> <p>Andra portföljbaserade PTRR-tjänster: En riskreduceringstjänst efter handel som tillhandahålls av en tjänsteleverantör för att minska risken i befintliga handelsportföljer som använder icke-prisbildande transaktioner och där en sådan tjänst inte uppfyller kraven för</p>

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			portföljkompression eller portföljomfördelning.
40	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Leverantör av riskreduceringstjänst efter handel	LEI-kod för leverantören av riskreduceringstjänsten efter handel.
41	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Handelsplats	<p>Identifiering av den plats där transaktionen utfördes.</p> <p>Använd MIC-koden för segmentet enligt ISO 10383 för transaktioner som genomförs på en handelsplats, via en systematisk internhandlare eller på en organiserad handelsplattform utanför unionen. Om segmentets MIC-kod inte existerar, använd den operativa MIC-koden.</p> <p>Använd MIC-koden "XOFF" för finansiella instrument som är godkända för handel eller som handlas på en handelsplats eller för vilka en ansökan om godkännande har gjorts, om transaktionen med det finansiella instrumentet inte genomförs på en handelsplats, via en systematisk internhandlare eller en organiserad handelsplattform utanför unionen, eller där en motpart inte vet att den handlar med en motpart 2 som fungerar som en systematisk internhandlare.</p> <p>Använd MIC-koden "XXXX" för finansiella instrument som</p>

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			inte är godkända för handel eller som inte handlas på en handelsplats eller för vilka en ansökan om godkännande inte har gjorts och som inte handlas på en organiserad handelsplattform utanför unionen.
42	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Genomförandetillfälle	Datum och tid då en transaktion ursprungligen utfördes, som ledde till att en ny UTI-kod genererades. Detta dataelement förblir oförändrat under UTI-kodens hela livslängd. Vid rapportering av positionsnivå bör det avse den tidpunkt då positionen öppnades för första gången.
43	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdande	Ojusterat datum då skyldigheterna enligt OTC-derivattransaktionen träder i kraft, enligt bekräftelsen. Om ikraftträdandedatumet inte anges som en del av villkoren i kontraktet ska motparterna i detta fält rapportera datumet för derivatets genomförande.
44	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Sista giltighetsdatum	Ojusterat datum då skyldigheterna enligt derivattransaktionen upphör att gälla, enligt bekräftelsen. Förtida avslutande påverkar inte detta dataelement.
45	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Datum för förtida avslutande	Datum då det förtida avslutandet (upphörandet) av den rapporterade transaktionen träder i kraft. Detta dataelement är tillämpligt om transaktionen

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			avslutas före förfallodagen på grund av ett interimistiskt beslut av en motpart (eller motparter).
46	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Slutlig avtalad avvecklingsdag	Ojusterat datum enligt avtalet, då all överföring av kontanter eller tillgångar bör ske och motparterna inte längre bör ha några utestående förpliktelser gentemot varandra enligt det avtalet. För produkter som kanske inte har någon slutlig avtalad avvecklingsdag (t.ex. amerikanska optioner) återspeglar detta dataelement det datum då överföringen av kontanter eller tillgångar skulle äga rum om avslutandet skulle ske på förfallodagen.
47	Avsnitt 2c – uppgifter om transaktionen	Typ av leverans	Anger om kontraktet avvecklas fysiskt eller kontant.
48	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Pris	Pris som anges i derivattransaktionen. Det omfattar inte avgifter, skatter eller provisioner. Om priset inte är känt när en ny transaktion rapporteras uppdateras priset när det blir tillgängligt. För transaktioner som ingår i ett paket innehåller detta dataelement priset för komponenttransaktionen i tillämpliga fall.
49	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Prisvaluta	Valuta som priset är denominerat i. Prisvalutan är endast tillämplig om priset uttrycks som monetärt värde.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
	Fälten 50–52 kan upprepas och ska fyllas i för derivat som inbegriper pristabeller.		
50	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ojusterat ikraftträdandedatum för priset	Ojusterat ikraftträdandedatum för priset
51	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ojusterat slutdatum för priset	Ojusterat slutdatum för priset (ej tillämpligt om det ojusterade slutdatumet för en viss tabellperiod infaller direkt före det ojusterade ikraftträdandedatumet för efterföljande period).
52	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Pris som gäller från det ojusterade ikraftträdandedatumet till och med det ojusterade slutdatumet.	Pris som gäller från det ojusterade ikraftträdandedatumet till och med det ojusterade slutdatumet.
53	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Pris för pakettransaktion	Handelspriset för hela det paket i vilket den rapporterade derivattransaktionen är en komponent. Detta dataelement är inte tillämpligt om <ul style="list-style-type: none"> <li>• inget paket ingår, eller</li> <li>• pakettransaktionsspreaden används.</li> </ul> Priser och därtill hörande dataelement för transaktioner (prisvaluta) som representerar enskilda komponenter i paketet rapporteras när de finns tillgängliga. Pakettransaktionspriset kanske inte är känt när en ny transaktion rapporteras, men kan komma att uppdateras senare.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
54	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Valuta för pakettransaktionens pris	Valuta som pakettransaktionens pris är denominerat i. Detta dataelement är inte tillämpligt om <ul style="list-style-type: none"> <li>• inget paket ingår, eller</li> <li>• pakettransaktionsspreaden används, eller</li> <li>• pakettransaktionens pris uttrycks i procent.</li> </ul>
55	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp för del 1	Teoretiskt belopp för del 1 i enlighet med artikel 5 i denna förordning.
56	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk valuta 1	I tillämpliga fall: den valuta i vilken det teoretiska beloppet för del 1 är denominerat.
	Fälten 57–59 kan upprepas och ska fyllas i för derivat som omfattar tabeller för teoretiska belopp.		
57	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för det teoretiska beloppet för del 1	Ojusterat datum då det tillhörande teoretiska beloppet för del 1 träder i kraft.
58	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för det teoretiska beloppet för del 1	Ojusterat slutdatum för det teoretiska beloppet för del 1 (ej tillämpligt om det ojusterade slutdatumet för en viss tabellperiod infaller direkt före det ojusterade ikraftträdandedatumet för den därpå följande perioden).
59	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp som gäller på det tillhörande ikraftträdandedatumet för del 1	Teoretiskt belopp för del 1 som träder i kraft på det tillhörande ojusterade ikraftträdandedatumet.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
60	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Total teoretisk kvantitet för del 1	Aggregerad teoretisk kvantitet av den underliggande tillgången för del 1 under transaktionens löptid. Om den totala teoretiska kvantiteten inte är känd när en ny transaktion rapporteras uppdateras den totala teoretiska kvantiteten när den blir tillgänglig.
	Fälten 61–63 kan upprepas och ska fyllas i för derivat som omfattar tabeller för teoretiska kvantiteter.		
61	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för den teoretiska kvantiteten för del 1	Ojusterat datum då den tillhörande teoretiska kvantiteten för del 1 träder i kraft.
62	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för den teoretiska kvantiteten för del 1	Ojusterat slutdatum för den teoretiska kvantiteten för del 1 (ej tillämpligt om det ojusterade slutdatumet för en viss tabellperiod infaller direkt före det ojusterade ikraftträdandedatumet för efterföljande period).
63	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk kvantitet som gäller på tillhörande ikraftträdandedatum för del 1	Teoretisk kvantitet för del 1 som träder i kraft på det tillhörande ojusterade ikraftträdandedatumet.
64	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp för del 2	I tillämpliga fall, teoretiskt belopp för del 2 i enlighet med artikel 5 i denna förordning.
65	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk valuta 2	I tillämpliga fall: den valuta i vilken det teoretiska beloppet för del 2 är denominerat.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
	Fälten 66–68 kan upprepas och ska fyllas i för derivat som omfattar tabeller för teoretiska belopp.		
66	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för det teoretiska beloppet för del 2	Ojusterat datum då det tillhörande teoretiska beloppet för del 2 träder i kraft.
67	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för det teoretiska beloppet för del 2	Ojusterat slutdatum för det teoretiska beloppet för del 2 (ej tillämpligt om det ojusterade slutdatumet för en viss tabellperiod infaller direkt före det ojusterade ikraftträdandedatumet för den därpå följande perioden).
68	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretiskt belopp som gäller på tillhörande ikraftträdandedatum för del 2	Det teoretiska belopp för del 2 som träder i kraft på det tillhörande ojusterade ikraftträdandedatumet.
69	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Total teoretisk kvantitet för del 2	Aggregerad teoretisk kvantitet av den underliggande tillgången för del 2 under transaktionens löptid. Om den totala teoretiska kvantiteten inte är känd när en ny transaktion rapporteras uppdateras den totala teoretiska kvantiteten när den blir tillgänglig.
	Fälten 70–72 kan upprepas och ska fyllas i för derivat som omfattar tabeller för teoretiska kvantiteter.		
70	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Ikraftträdandedatum för den teoretiska kvantiteten för del 2	Ojusterat datum då den tillhörande teoretiska kvantiteten för del 2 träder i kraft.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
71	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Slutdatum för den teoretiska kvantiteten för del 2	Ojusterat slutdatum för den teoretiska kvantiteten för del 2 (ej tillämpligt om det ojusterade slutdatumet för en viss tabellperiod infaller direkt före det ojusterade ikraftträdandedatumet för efterföljande period).
72	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Teoretisk kvantitet som gäller på tillhörande ikraftträdandedatum för del 2	Teoretiskt belopp för del 2 som träder i kraft på det tillhörande ojusterade ikraftträdandedatumet.
	Avsnittet medfälten 73–78 kan upprepas		
73	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalningstyp	Typ av annat betalningsbelopp. Optionspremiebetalning ingår inte som betalningstyp eftersom optionspremier rapporteras med hjälp av optionspremiespecifika dataelement.
74	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annat betalningsbelopp	Betalningsbelopp med motsvarande betalningstyper för att tillgodose kraven på transaktionsbeskrivningar från olika tillgångsklasser.
75	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalningsvaluta	Valuta som Annat betalningsbelopp är denominerat i.
76	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annat betalningsdatum	Ojusterat datum då det andra betalningsbeloppet betalas.
77	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalare	Identifieringskod för betalaren av Annat betalningsbelopp.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
78	Avsnitt 2g – uppgifter om transaktionen	Annan betalningsmottagare	Identifikationskod för mottagaren av Annat betalningsbelopp.
79	Avsnitt 2h – räntor	Fast ränta för del 1 eller kupong	Uppgift om använd fast ränta för del 1 eller kupong, om tillämpligt.
80	Avsnitt 2h – räntor	Fast ränta eller dagberäkningsmetod för kupong för del 1	I tillämpliga fall: dagberäkningskonvention (ofta även kallad dagberäkningsfraktion eller dagberäkningsbas eller dagberäkningsmetod) som avgör hur räntebetalningar beräknas. Den används för att beräkna årsandelen för beräkningsperioden och anger antalet dagar i beräkningsperioden dividerat med antalet dagar under året.
81	Avsnitt 2h – räntor	Fast ränta eller betalningsfrekvensperiod för kupong för del 1	I tillämpliga fall: tidsenhet som är knuten till betalningsfrekvensen, t.ex. dag, vecka, månad, år eller löptid för den fasta ränteströmmen för del 1 eller kupongen.
82	Avsnitt 2h – räntor	Fast ränta eller multiplikator för betalningsfrekvensperiod för kupong för del 1	I tillämpliga fall: antal tidsenheter (uttryckt i betalningsfrekvensperioden) som avgör hur ofta periodiska betalningsdagar infaller för den fasta räntan för del 1 eller kupongen. Exempelvis representeras en transaktion med betalningar som infaller varannan månad med betalningsfrekvensen ”MNTM” (månadsvis) och en multiplikator för betalningsfrekvensperioden på 2.

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>Detta dataelement är inte tillämpligt om betalningsfrekvensperioden är "ADHO". Om betalningsfrekvensperioden är "EXPI" är multiplikatorn för betalningsfrekvensperioden 1. Om betalningsfrekvensen är intradag är betalningsfrekvensperioden "DAIL" och multiplikatorn för betalningsfrekvensen är 0.</p>
83	Avsnitt 2h – räntor	Identifieringskod för rörlig ränta för del 1	I tillämpliga fall: en identifieringskod för de använda räntesatserna som justeras med förutbestämda intervall, med hänvisning till en marknadsreferensränta.
84	Avsnitt 2h – räntor	Uppgift om rörlig ränta för del 1	Uppgift om räntan, i förekommande fall.
85	Avsnitt 2h – räntor	Namn på rörlig ränta för del 1	Räntans fullständiga namn som bestämts av indexleverantören.
86	Avsnitt 2h – räntor	Dagberäkningsmetod för rörlig ränta för del 1	I tillämpliga fall: dagberäkningskonvention (ofta även kallad dagberäkningsfraktion eller dagberäkningsbas eller dagberäkningsmetod) som avgör hur räntebetalningarna för den rörliga räntan för del 1 beräknas. Den används för att beräkna årsandelen för beräkningsperioden och anger antalet dagar i beräkningsperioden dividerat med antalet dagar under året.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
87	Avsnitt 2h – räntor	Betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 1	I tillämpliga fall: tidsenhet som är knuten till betalningsfrekvensen, t.ex. dag, vecka, månad, år eller löptid för den rörliga ränteströmmen för del 1.
88	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 1	I tillämpliga fall: antal tidsenheter (uttryckt i betalningsfrekvensperioden) som avgör hur ofta periodiska betalningsdagar infaller för den rörliga räntan för del 1. Exempelvis representeras en transaktion med betalningar som infaller varannan månad med betalningsfrekvensen ”MNTH” (månadsvis) och en multiplikator för betalningsfrekvensperioden på 2. Detta dataelement är inte tillämpligt om betalningsfrekvensperioden är ”ADHO”. Om betalningsfrekvensperioden är ”EXPI” är multiplikatorn för betalningsfrekvensperioden 1. Om betalningsfrekvensen är intradag är betalningsfrekvensperioden ”DAIL” och multiplikatorn för betalningsfrekvensen är 0.
89	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 1 – periodangivelse	Period som utgör referensperiod för rörlig ränta del 1.
90	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 1 – multiplikator	Multiplikator för perioden som utgör referensperiod för rörlig ränta del 1.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
91	Avsnitt 2h – räntor	Justeringsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 1	I tillämpliga fall: tidsenhet som är knuten till hur ofta betalningarna justeras, t.ex. dag, vecka, månad, år eller löptid för den rörliga ränteströmmen för del 1.
92	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för justeringsfrekvens för rörlig ränta för del 1	I tillämpliga fall: antal tidsenheter (uttryckt i betalningsfrekvensperioden) som avgör hur ofta periodiska betalningsjusteringsdagar infaller för den rörliga räntan för del 1. Exempelvis representeras en transaktion med betalningar som infaller varannan månad med betalningsfrekvensen "MNTM" (månadsvis) och en multiplikator för betalningsfrekvensperioden på 2. Detta dataelement är inte tillämpligt om betalningsfrekvensperioden är "ADHO". Om betalningsfrekvensperioden är "EXPI" är multiplikatorn för betalningsfrekvensperioden 1. Om betalningsfrekvensen är intradag är betalningsfrekvensperioden "DAIL" och multiplikatorn för betalningsfrekvensen är 0.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
93	Avsnitt 2h – räntor	Spread för del 1	Uppgift om spreaden för del 1, i tillämpliga fall: För OTC-derivattransaktioner med periodiska betalningar (t.ex. ränteswappar för fast/rörlig ränta, räntebasswappar, råvaruswappar). <ul style="list-style-type: none"> <li>• spreaden för referenspriset för det eller de enskilda rörliga delindexen, om det finns en spread på en rörlig del.</li> <li>• skillnaden mellan referenspriserna för de två rörliga delindexen.</li> </ul>
94	Avsnitt 2h – räntor	Spreadvaluta för del 1	I tillämpliga fall: den valuta i vilken spreaden för del 1 är denominerad. Detta dataelement är endast tillämpligt om spreaden uttrycks som ett penningbelopp.
95	Avsnitt 2h – räntor	Fast ränta del 2	Uppgift om den använda fasta räntan för del 2, i tillämpliga fall.
96	Avsnitt 2h – räntor	Dagberäkningsmetod för fast ränta för del 2	I tillämpliga fall: dagberäkningskonvention (ofta även kallad dagberäkningsfraktion eller dagberäkningsbas eller dagberäkningsmetod) som avgör hur räntebetalningar beräknas. Den används för att beräkna årsandelen för beräkningsperioden och anger antalet dagar i beräkningsperioden dividerat med antalet dagar under året.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
97	Avsnitt 2h – räntor	Betalningsfrekvensperiod för fast ränta för del 2	I tillämpliga fall: tidsenhet som är knuten till betalningsfrekvensen, t.ex. dag, vecka, månad, år eller löptid för den fasta ränteströmmen för del 2.
98	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för betalningsfrekvensperiod för fast ränta för del 2	I tillämpliga fall: antal tidsenheter (uttryckt i betalningsfrekvensperioden) som avgör hur ofta periodiska betalningsdagar infaller för den fasta räntan för del 2. Exempelvis representeras en transaktion med betalningar som infaller varannan månad med betalningsfrekvensen ”MNTH” (månadsvis) och en multiplikator för betalningsfrekvensperioden på 2. Detta dataelement är inte tillämpligt om betalningsfrekvensperioden är ”ADHO”. Om betalningsfrekvensperioden är ”EXPI” är multiplikatorn för betalningsfrekvensperioden 1. Om betalningsfrekvensen är intradag är betalningsfrekvensperioden ”DAIL” och multiplikatorn för betalningsfrekvensen är 0.
99	Avsnitt 2h – räntor	Identifieringskod för rörlig ränta för del 2	I tillämpliga fall: en identifieringskod för de använda räntesatserna som justeras med förutbestämda intervall, med hänvisning till en marknadsreferensränta.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
100	Avsnitt 2h – räntor	Indikator för rörlig ränta för del 2	Uppgift om räntan, i förekommande fall.
101	Avsnitt 2h – räntor	Namn på rörlig ränta för del 2	Räntans fullständiga namn som bestämts av indexleverantören.
102	Avsnitt 2h – räntor	Dagberäkningsmetod för rörlig ränta för del 2	I tillämpliga fall: dagberäkningskonvention (ofta även kallad dagberäkningsfraktion eller dagberäkningsbas eller dagberäkningsmetod) som avgör hur räntebetalningarna för den rörliga räntan för del 2 beräknas. Den används för att beräkna årsandelen för beräkningsperioden och anger antalet dagar i beräkningsperioden dividerat med antalet dagar under året.
103	Avsnitt 2h – räntor	Betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 2	I tillämpliga fall: tidsenhet som är knuten till betalningsfrekvensen, t.ex. dag, vecka, månad, år eller löptid för den rörliga ränteströmmen för del 2.
104	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för betalningsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 2	I tillämpliga fall: antal tidsenheter (uttryckt i betalningsfrekvensperioden) som avgör hur ofta periodiska betalningsdagar infaller för den rörliga räntan för del 2. Exempelvis representeras en transaktion med betalningar som infaller varannan månad med betalningsfrekvensen ”MNTH” (månadsvis) och en multiplikator för betalningsfrekvensperioden på 2. Detta dataelement är inte

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			tillämpligt om betalningsfrekvensperioden är "ADHO". Om betalningsfrekvensperioden är "EXPI" är multiplikatorn för betalningsfrekvensperioden 1. Om betalningsfrekvensen är intradag är betalningsfrekvensperioden "DAIL" och multiplikatorn för betalningsfrekvensen är 0.
105	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 2 – periodangivelse	Period som utgör referensperiod för rörlig ränta för del 2.
106	Avsnitt 2h – räntor	Referensperiod för rörlig ränta för del 2 – multiplikator	Multiplikator för perioden som utgör referensperiod för rörlig ränta för del 2.
107	Avsnitt 2h – räntor	Justeringsfrekvensperiod för rörlig ränta för del 2	I tillämpliga fall: tidsenhet som är knuten till hur ofta betalningarna justeras, t.ex. dag, vecka, månad, år eller löptid för den rörliga ränteströmmen för del 2.
108	Avsnitt 2h – räntor	Multiplikator för justeringsfrekvens för rörlig ränta för del 2	I tillämpliga fall: antal tidsenheter (uttryckt i betalningsfrekvensperioden) som avgör hur ofta periodiska betalningsjusteringsdagar infaller för den rörliga räntan för del 2. Exempelvis representeras en transaktion med betalningar som infaller varannan månad med betalningsfrekvensen "MNTH" (månadsvis) och en multiplikator för betalningsfrekvensperioden på 2. Detta dataelement är inte tillämpligt om betalningsfrekvensperioden

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			är "ADHO". Om betalningsfrekvensperioden är "EXPI" är multiplikatorn för betalningsfrekvensperioden 1. Om betalningsfrekvensen är intradag är betalningsfrekvensperioden "DAIL" och multiplikatorn för betalningsfrekvensen är 0.
109	Avsnitt 2h – räntor	Spread för del 2	Uppgift om spreaden för del 2, i tillämpliga fall: för OTC-derivattransaktioner med periodiska betalningar (t.ex. ränteswappar med fast eller rörlig ränta, räntebasswappar, råvaruswappar). <ul style="list-style-type: none"> <li>• spreaden för referenspriset för det eller de enskilda rörliga delindexen, om det finns en spread på en rörlig del.</li> <li>• skillnaden mellan referenspriserna för de två rörliga delindexen.</li> </ul>
110	Avsnitt 2h – räntor	Spreadvaluta för del 2	I tillämpliga fall: den valuta i vilken spreaden för del 2 är denominerad. Detta dataelement är endast tillämpligt om spreaden uttrycks som ett penningbelopp.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
111	Avsnitt 2h – räntor	Spread för pakettransaktion	<p>Handelspriset för hela det paket i vilket den rapporterade derivattransaktionen är en komponent i en pakettransaktion. Pakettransaktionspriset när paketets pris uttrycks som en spread, skillnaden mellan två referenspriser. Detta dataelement är inte tillämpligt om</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• inget paket ingår, eller</li> <li>• pakettransaktionspriset används.</li> </ul> <p>Spreaden och därtill hörande dataelement för transaktioner (spreadvaluta) som representerar enskilda komponenter i paketet rapporteras när de finns tillgängliga. Pakettransaktionsspreaden kanske inte är känd när en ny transaktion rapporteras, men kan komma att uppdateras senare.</p>
112	Avsnitt 2h – räntor	Spreadvaluta för pakettransaktion	<p>Valuta som pakettransaktionsspreaden är denominerad i. Detta dataelement är inte tillämpligt om</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• inget paket ingår, eller</li> <li>• pakettransaktionspriset används, eller</li> <li>• pakettransaktionsspreaden uttrycks i procent eller baspunkter.</li> </ul>
113	Avsnitt 2i – utländsk valuta	Växelkurs 1	<p>Växelkursen mellan de två olika valutor som anges i derivattransaktionen och som avtalas mellan motparterna när transaktionen inleds, uttryckt som växelkursen</p>

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			från omräkning av basvalutan till motvalutan.
114	Avsnitt 2i – utländsk valuta	Terminsväxelkurs	Terminsväxelkursen enligt överenskommelse mellan motparterna i avtalet. Den ska uttryckas som pris på basvalutan i motvalutan.
115	Avsnitt 2i – utländsk valuta	Valutakombination för växelkurs	Det valutapar och den ordning i vilken växelkursen är denominerad, uttryckt som basvaluta eller motvaluta.
116	Avsnitt 2j – råvaror och utsläppsrätter (allmänt)	Basprodukt	Basprodukt enligt klassificeringen av varor i tabell 4 i bilagan till <i>[Publikationsbyrån: infoga hänvisning till C(2022) 3588]</i> .
117	Avsnitt 2j – råvaror och utsläppsrätter (allmänt)	Underprodukt	Underprodukt enligt klassificeringen av varor i tabell 4 i bilagan till <i>[Publikationsbyrån: infoga hänvisning till C(2022) 3588]</i> . Detta fält kräver att en särskild basprodukt anges i fältet.
118	Avsnitt 2j – råvaror och utsläppsrätter (allmänt)	Ytterligare underprodukt	Ytterligare underprodukt enligt klassificeringen av varor i tabell 4 i bilagan till <i>[Publikationsbyrån: infoga hänvisning till C(2022) 3588]</i> . Detta fält kräver att en särskild underprodukt anges i fältet.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
119	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveransställe eller -zon	Leveransställe(n) eller marknadsområde(n).
120	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Förbindelsepunkt	Uppgift om gräns(er) eller gränspunkt(er) i ett transportavtal.
121	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Lasttyp	Uppgift om leveransprofil.
	Avsnittet medfälten 122–131 kan upprepas		
122	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Starttid för leveransintervall	Starttid för leveransintervallet för varje block eller form.
123	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Sluttid för leveransintervall	Sluttid för leveransintervallet för varje block eller form.
124	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveransens startdatum	Startdatum för leveransen.
125	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveransens slutdatum	Slutdatum för leveransen.
126	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Löptid	Leveransperiodens varaktighet.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
127	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Veckodagar	Veckodagar för leverans.
128	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Leveranskapacitet	Antal enheter som ingår i transaktionen för varje leveransintervall som anges i fälten 122 och 123.
129	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Kvantitetsmått	Den använda måttenheten.
130	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Pris/tidsintervall och kvantitet	I förekommande fall pris per kvantitet för varje tidsintervall i leveransen.
131	Avsnitt 2k – råvaror och utsläppsrätter (energi)	Valuta för pris/tidsintervall och kvantitet	Den valuta i vilken priset per tidsintervall och kvantitet anges.
132	Avsnitt 2l – optioner	Optionsslag	Uppgift om huruvida derivatkontraktet är en köption (rätt att köpa en viss underliggande tillgång) eller en säljoption (rätt att sälja en viss underliggande tillgång) eller om det vid derivatkontraktets verkställande inte går att avgöra om det rör sig om en köp- eller säljoption. Vid swapoptioner ska anges: – ”Put” för en mottagarswapoption, där köparen har rätt att ingå ett swapavtal som mottagare av fast ränta.

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>– ”Call” för en betalarswapoption, där köparen har rätt att ingå ett swapavtal som betalare av en fast ränta.</p> <p>Vid tak (caps) och golv (floors) ska anges:</p> <p>– ”Put” vid golv.</p> <p>– ”Call” vid tak.</p>
133	Avsnitt 21 – optioner	Optionstyp	Ange om optionen endast får lösas in vid ett bestämt datum (europeiska optioner), vid vissa tidpunkter med bestämda intervall (Bermudaoptioner) eller när som helst under kontraktstiden (amerikanska optioner).
134	Avsnitt 21 – optioner	Lösenpris	<ul style="list-style-type: none"> <li>• För andra optioner än valutaoptioner, swapoptioner och liknande produkter, det pris till vilket ägaren till en option kan köpa eller sälja optionens underliggande tillgång.</li> <li>• För valutaoptioner, den växelkurs till vilken optionen kan utnyttjas, uttryckt som växelkursen från omvandling av basvalutan till motvalutan. I exemplet 0,9426 US-dollar/EUR är US-dollar basvalutan och EUR motvalutan. USD 1 = EUR 0,9426. Om lösenpriset inte är känt när en ny transaktion rapporteras uppdateras lösenpriset när det blir tillgängligt.</li> <li>• För volatilitet och variansswappar och liknande produkter</li> </ul>

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
			rapporteras lösenpriset för volatilitet i detta dataelement.
	Fälten 135–137 kan upprepas och ska fyllas i om det rör sig om derivat som inbegriper lösenpristabeller.		
135	Avsnitt 21 – optioner	Ikraftträdandedatum för lösenpriset	Ojusterat ikraftträdandedatum för lösenpriset.
136	Avsnitt 21 – optioner	Slutdatum för lösenpriset	Ojusterat slutdatum för lösenpriset (ej tillämpligt om det ojusterade slutdatumet för en viss tabellperiod infaller direkt före det ojusterade ikraftträdandedatumet för efterföljande period).
137	Avsnitt 21 – optioner	Lösenpris som gäller på tillhörande ikraftträdandedatum	Lösenpris som gäller från det ojusterade ikraftträdandedatumet till och med det ojusterade slutdatumet.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
138	Avsnitt 2l – optioner	Lösenprisets valuta/valutapar	För aktieoptioner, råvaruoptioner och liknande produkter, valuta i vilken lösenpriset är denominerat. För valutaoptioner: Valutapar och den ordning i vilken lösenpriset är angivet. Det uttrycks som basvaluta per motvaluta.
139	Avsnitt 2l – optioner	Belopp för optionspremium	För optioner och swaptioner av alla tillgångsklasser, penningbelopp som betalas av optionsköparen. Detta dataelement är inte tillämpligt om instrumentet inte är en option eller inte innehåller någon optionalitet.
140	Avsnitt 2l – optioner	Valuta för optionspremium	För optioner och swaptioner av alla tillgångsklasser, valuta i vilken optionens premiebelopp är angivet. Detta dataelement är inte tillämpligt om instrumentet inte är en option eller inte innehåller någon optionalitet.
141	Avsnitt 2l – optioner	Betalningsdatum för optionspremium	Ojusterat datum då optionspremium betalas.
142	Avsnitt 2i – optioner	Förfallodag för det underliggande	Vid swaptioner, förfallodag för den underliggande swappen.
143	Sektion 2m – kreditderivat	Prioritet	Anger företräde för skuldebrev, eller skuldkorg eller index som ligger till grund för ett derivat.
144	Sektion 2m – kreditderivat	Referensenhet	Uppgift om underliggande referensenhet.

	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
145	Sektion 2m – kreditderivat	Serier	Serienummer för indexets sammansättning, om tillämpligt
146	Sektion 2m – kreditderivat	Version	En ny version av en serie utfärdas vid fallissemang för en av de ingående delarna och indexet måste viktas om för att ta hänsyn till det nya antalet totala ingående delar i indexet
147	Sektion 2m – kreditderivat	Indexfaktor	Faktor för att justera det teoretiska värdet (fält 55 i denna tabell) till alla tidigare kredithändelser i indexserien.
148	Sektion 2m – kreditderivat	Tranch	Uppgift om huruvida ett derivatkontrakt delas upp i trancher.
149	Sektion 2m – kreditderivat	Attachment point för index för kreditderivatswappar (CDS)	Definierad lägre punkt där förlustnivån i den underliggande portföljen minskar det teoretiska värdet av en tranch. Det teoretiska värdet av en tranch med en attachment point på 3 % kommer till exempel att minskas efter att det har inträffat 3 % förluster i portföljen. Detta dataelement är inte tillämpligt om transaktionen inte är en CDS-tranchtransaktion (index eller anpassad korg).
150	Sektion 2m – kreditderivat	Detachment point för index för kreditderivatswappar	Definierad punkt efter vilken förlusterna i den underliggande portföljen inte längre minskar det teoretiska värdet av en tranch. Det teoretiska värdet av en tranch med en attachment point på 3 % och

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			en detachment point på 6 % kommer till exempel att minskas efter att det har inträffat 3 % förluster i portföljen. Förluster på 6 % i portföljen uttömmar tranchens teoretiska värde. Detta dataelement är inte tillämpligt om transaktionen inte är en CDS-tranchtransaktion (index eller anpassad korg).
151	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Åtgärdstyp	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Ny: En rapport om ett derivat, på transaktions- eller positionsnivå, för första gången.</li> <li>• Ändra: En ändring av villkoren för eller uppgifterna om ett tidigare rapporterat derivat, på transaktions- eller positionsnivå, men inte en korrigering av en rapport.</li> <li>• Korrigera: En rapport som korrigerar felaktiga datafält i en tidigare inlämnad rapport.</li> <li>• Avsluta: Avslutande av ett befintligt derivat, på transaktions- eller positionsnivå.</li> <li>• Fel: En annullering av en hel rapport som har lämnats in felaktigt för ett derivat som, på transaktions- eller positionsnivå, aldrig kom till stånd eller inte omfattades av rapporteringskraven enligt förordning (EU) nr 648/2012 men som rapporterades till ett transaktionsregister av misstag, eller en annullering av en duplikatrapport.</li> <li>• Förnya: Återupptagande av ett derivat, på</li> </ul>

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>transaktions- eller positionsnivå, som annullerades med åtgärdstypen ”Fel” eller avslutades av misstag.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Värdering: En uppdatering av en värdering av ett derivat, på transaktions- eller positionsnivå.</li> <li>• Positionskomponent: En rapport om ett nytt derivat som ingår i en separat positionsrapport samma dag.</li> </ul>
152	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Händelsetyp	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Handel: Ingående av ett derivat eller omförhandling av dess villkor som inte leder till en ändring av en motpart</li> <li>• Step-in: En händelse där en del av eller hela derivatet överförs till en motpart 2 (och rapporteras som ett nytt derivat) och det befintliga derivatet antingen avslutas eller dess teoretiska värde ändras.</li> <li>• Riskreduceringstjänst efter handel Riskreducering efter handel</li> <li>• Förtida avslutande: Avslutande av ett derivat, på transaktions- eller positionsnivå.</li> <li>• Clearing: Clearing enligt definitionen i artikel 2.3 i förordning (EU) nr 648/2012.</li> <li>• Utnyttjande: En motparts utnyttjande av en option eller en swaption i transaktionen, helt eller delvis.</li> <li>• Tilldelning: Tilldelningshändelse där ett befintligt derivat tilldelas till olika motparter och</li> </ul>

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>rapporteras som nya derivat med reducerade teoretiska belopp.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Kredithändelse: Gäller endast kreditderivat. En kredithändelse som leder till en ändring av ett derivat, på transaktions- eller positionsnivå.</li> <li>Företagshändelse: En företagsåtgärd avseende underliggande aktier som påverkar derivaten på de aktierna</li> <li>• Inkludering i position: Inkludering av ett motpartsclearat derivat eller CFD-kontrakt i en position, där ett befintligt derivat avslutas och antingen en ny position skapas eller ett teoretiskt värde för en befintlig position ändras.</li> </ul> <p>Uppdatering – Uppdatering av ett utestående derivat som utförts under övergångsperioden för att säkerställa dess förenlighet med de ändrade rapporteringskraven</p>
153	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Datum för händelsen	Datum då den händelse som ska rapporteras avseende derivatkontraktet och som tas upp i rapporten ägde rum eller, när det gäller en ändring, när ändringen trädde i kraft.
154	Avsnitt 2n – ändring av derivatet	Nivå	<p>Uppgift om huruvida rapporten är utfärdad på transaktions- eller positionsnivå.</p> <p>En rapport på positionsnivå kan bara användas för att komplettera rapportering på transaktionsnivå för att rapportera händelser efter</p>

	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			handel, och endast om de enskilda transaktionerna i fungibla produkter har ersatts av positionen.

Tabell 3

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
1	Parter i derivatet	Rapporteringstillfälle	Datum och klockslag för inlämning av rapport till transaktionsregistret.
2	Parter i derivatet	Rapportinlämnande enhets ID	Om den enhet som ansvarar för rapporteringen har delegerat inlämnandet av rapporten till en tredje part eller till den andra motparten ska den enheten identifieras i detta fält med en unik kod. I annat fall bör den enhet som ansvarar för rapporteringen anges i detta fält.
3	Parter i derivatet	Enhet som ansvarar för rapporteringen	Om en finansiell motpart är ensamt ansvarig, även juridiskt sett, för rapportering för båda motparternas räkning i enlighet med artikel 9.1a i förordning (EU) nr 648/2012 och den icke-finansiella motparten inte beslutar att själv rapportera uppgifterna om sina OTC-derivatkontrakt med den finansiella motparten: den finansiella motpartens unika identifieringskod. Om ett förvaltningsbolag är ansvarigt, även juridiskt sett, för rapporteringen på vägnar av ett företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (fondföretag) i enlighet med artikel 9.1b i samma förordning: förvaltningsbolagets unika identifieringskod. Om en förvaltare av alternativa investeringsfonder (AIF-förvaltare) är ansvarig, även juridiskt sett, för rapporteringen på en alternativ investeringsfonds vägnar i enlighet med artikel 9.1c i den förordningen: AIF-förvaltarens unika identifieringskod. Om en

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>auktoriserad enhet som är ansvarig för att förvalta ett tjänstepensionsinstitut och agera å dess vägnar är ansvarig, även juridiskt sett, för att för dess räkning rapportera i enlighet med artikel 9.1d i den förordningen: den enhetens unika identifieringskod.</p> <p>Detta fält gäller endast OTC-derivat.</p>
4	Parter i derivatet	Motpart 1 (rapporterande motpart)	<p>Identifieringskod för den motpart i en derivattransaktion som fullgör sin rapporteringsskyldighet via rapporten i fråga.</p> <p>När det gäller en allokerad derivattransaktion som utförs av en fondförvaltare för en fonds räkning rapporteras fonden och inte fondförvaltaren som motpart.</p>
5	Parter i derivatet	Typ av identifieringskod för motpart 2	Indikator för huruvida LEI-koden användes för att identifiera motpart 2.
6	Parter i derivatet	Motpart 2	<p>Identifieringskod för den andra motparten i en derivattransaktion.</p> <p>När det gäller en allokerad derivattransaktion som utförs av en fondförvaltare för en fonds räkning rapporteras fonden och inte fondförvaltaren som motpart.</p>
7	Säkerhet	Tidsstämpel för säkerheten	Datum och tid från och med vilken marginalsäkerheternas värden rapporteras.

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
8	Säkerhet	Indikator för portföljsäkerhet	Indikator för om säkerheten ställts på portföljbasis. Med ”på portföljbasis” avses en uppsättning transaktioner för vilka marginalsäkerheten ställs tillsammans (antingen netto eller brutto), i motsats till ett scenario där marginalsäkerheten beräknas och bokförs separat för varje enskild transaktion.
9	Säkerhet	Kod för portföljsäkerhet	Om säkerheter rapporteras på portföljbasis, den unika kod som motpart 1 har tilldelat portföljen. Detta dataelement är inte tillämpligt om säkerheten ställts på transaktionsnivå eller om det inte finns något säkerhetsavtal eller om inga säkerheter ställs eller tas emot.
10	Säkerhet	UTI-kod	Unik transaktionskod enligt artikel 7 i [ <i>Publikationsbyrån: infoga hänvisning till C(2022) 3588</i> ].
11	Säkerhet	Kategori för ställande av säkerhet	Ange om ett avtal om säkerheter mellan motparterna föreligger. Detta dataelement tillhandahålls för varje transaktion eller portfölj beroende på om säkerheten ställs på transaktions- eller portföljnivå, och är tillämpligt på både clearade och oclearade transaktioner.

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
12	Säkerhet	Initial marginalsäkerhet som ställts av motpart 1 (före värderingsavdrag)	<p>Det monetära värdet av den initiala marginalsäkerhet som har ställts av motpart 1, inklusive eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling.</p> <p>Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den initiala marginalsäkerhet som ställts hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den initiala marginalsäkerhet som ställts den enskilda transaktionen.</p> <p>Detta fält avser den initiala marginalsäkerhetens totala aktuella värde snarare än dess dagliga förändring.</p> <p>Dataelementet avser både oclearade och centralt clearade transaktioner.</p> <p>För centralt clearade transaktioner omfattar dataelementet inte bidrag till obeståndsfonder eller säkerheter som ställs mot likviditetsavsättningar till den centrala motparten, dvs. beviljade kreditramar.</p> <p>Om den initiala marginalsäkerhet som ställts anges i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.</p>
13	Säkerhet	Initial marginalsäkerhet som ställts av motpart 1 (efter värderingsavdrag)	<p>Det monetära värdet av den initiala marginalsäkerhet som har ställts av motpart 1, inklusive eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling.</p> <p>Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den initiala marginalsäkerhet som ställts hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den initiala marginalsäkerhet som ställts den enskilda transaktionen.</p> <p>Detta fält avser den initiala marginalsäkerhetens totala aktuella värde efter tillämpning av värderingsavdraget (i tillämpliga fall) snarare än dess dagliga förändring.</p> <p>Dataelementet avser både oclearade och</p>

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			centralt clearade transaktioner. För centralt clearade transaktioner omfattar dataelementet inte bidrag till obeståndsfonder eller säkerheter som ställs mot likviditetsavsättningar till den centrala motparten, dvs. beviljade kreditramar. Om den initiala marginalsäkerhet som ställts anges i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.
14	Säkerhet	Valuta för den initiala marginalsäkerhet som ställts	Valuta i vilken den initiala marginalsäkerhet som ställts är denominerad. Om den initiala marginalsäkerhet som ställts är uttryckt i mer än en valuta återspeglar detta dataelement en av de valutor till vilka motpart 1 har valt att konvertera alla värden för de ställda initiala marginalsäkerheterna.
15	Säkerhet	Tilläggs marginalsäkerhet som ställts av motpart 1 (före värderingsavdrag)	Det monetära värdet av den tilläggs marginalsäkerhet som ställts av motpart 1, inklusive den kontantreglerade marginalsäkerheten och eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling. Villkorad tilläggs marginalsäkerhet ingår inte. Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den tilläggs marginalsäkerhet som ställts hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den tilläggs marginalsäkerhet som ställts en sådan enskild transaktion. Detta fält avser det totala aktuella värdet av tilläggs marginalsäkerheten, kumulerat sedan den första rapporteringen av de tilläggs marginalsäkerheter som ställts för portföljen eller transaktionen. Om den tilläggs marginalsäkerhet som ställts uttrycks i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.
16	Säkerhet	Tilläggsmarginalsäkerhet som ställts av motpart 1 (efter värderingsavdrag)	<p>Det monetära värdet av den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts av motpart 1, inklusive den kontantreglerade marginalsäkerheten och eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling.</p> <p>Villkorad tilläggsmarginalsäkerhet ingår inte.</p> <p>Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts en sådan enskild transaktion.</p> <p>Detta fält avser det totala aktuella värdet av tilläggsmarginalsäkerheten efter tillämpning av värderingsavdraget, i förekommande fall, kumulerat sedan den första rapporteringen av de tilläggsmarginalsäkerheter som ställts för portföljen eller transaktionen.</p> <p>Om den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts uttrycks i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.</p>

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
17	Säkerhet	Valuta för den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts	Valuta i vilken den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts är denominerad. Om den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts är denominerad i mer än en valuta återspeglar detta dataelement en av de valutor till vilka motpart 1 har valt att konvertera alla värden för de ställda tilläggsmarginalsäkerheterna.
18	Säkerhet	Överskjutande säkerhet som ställts av motpart 1	Det monetära värdet för eventuella ytterligare säkerheter som ställts av motpart 1 separat och oberoende av initiala marginalsäkerheter och tilläggsmarginalsäkerheter. Detta fält avser den överskjutande säkerhetens totala aktuella värde före tillämpning av värderingsavdraget, i tillämpliga fall, snarare än dess dagliga förändring. Alla belopp för initiala marginalsäkerheter eller tilläggsmarginalsäkerheter som ställts och som överstiger den initiala marginalsäkerhet som krävs eller den tilläggsmarginalsäkerhet som krävs, rapporteras som en del av den initiala marginalsäkerhet som ställts respektive den tilläggsmarginalsäkerhet som ställts i stället för som en del av den överskjutande säkerhet som ställts. För centralt clearade transaktioner rapporteras överskjutande säkerheter endast i den mån de kan hänföras till en specifik portfölj eller transaktion.
19	Säkerhet	Valuta för den överskjutande säkerhet som ställts	Valuta i vilken den överskjutande säkerhet som ställts är denominerad. Om den överskjutande säkerhet som ställts är denominerad i mer än en valuta återspeglar detta dataelement en av de valutor till vilka motpart 1 har valt att konvertera alla värden för de ställda överskjutande säkerheterna.

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
20	Säkerhet	Initial marginalsäkerhet som samlats in av motpart 1 (före värderingsavdrag)	<p>Det monetära värdet av den initiala marginalsäkerhet som har samlats in av motpart 1, inklusive eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling.</p> <p>Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den initiala marginalsäkerhet som samlats in hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den initiala marginalsäkerhet som samlats in en sådan enskild transaktion.</p> <p>Detta fält avser den initiala marginalsäkerhetens totala aktuella värde snarare än dess dagliga förändring.</p> <p>Dataelementet avser både oclearade och centralt clearade transaktioner. För centralt clearade transaktioner inkluderar dataelementet inte säkerheter som den centrala motparten samlat in som en del av sin investeringsverksamhet.</p> <p>Om den initiala marginalsäkerhet som samlats in är denominerad i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.</p>
21	Säkerhet	Initial marginalsäkerhet som samlats in av motpart 1 (efter värderingsavdrag)	<p>Det monetära värdet av den initiala marginalsäkerhet som har samlats in av motpart 1, inklusive eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling.</p> <p>Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den initiala marginalsäkerhet som samlats in hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den initiala marginalsäkerhet som samlats in en sådan enskild transaktion.</p> <p>Detta fält avser den initiala marginalsäkerhetens totala aktuella värde efter tillämpning av värderingsavdraget, i tillämpliga fall, snarare än dess dagliga förändring.</p> <p>Dataelementet avser både oclearade och centralt clearade transaktioner. För centralt</p>

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>clearade transaktioner inkluderar dataelementet inte säkerheter som den centrala motparten samlat in som en del av sin investeringsverksamhet.</p> <p>Om den initiala marginalsäkerhet som samlats in är denominerad i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.</p>
22	Säkerhet	Valuta för den initiala marginalsäkerhet som samlats in	<p>Valuta i vilken den initiala marginalsäkerhet som samlats in är denominerad.</p> <p>Om den initiala marginalsäkerhet som samlats in är denominerad i mer än en valuta återspeglar detta dataelement en av de valutor till vilka motpart 1 har valt att konvertera alla värden för de insamlade initiala marginalsäkerheterna.</p>
23	Säkerhet	Tilläggs marginalsäkerhet som samlats in av motpart 1 (före värderingsavdrag)	<p>Det monetära värdet av den tilläggs marginalsäkerhet som samlats in av motpart 1, inklusive den kontantreglerade marginalsäkerheten och eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling.</p> <p>Villkorad tilläggs marginalsäkerhet ingår inte.</p> <p>Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den tilläggs marginalsäkerhet som samlats in hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den tilläggs marginalsäkerhet som samlats in en sådan enskild transaktion.</p> <p>Detta fält avser det totala aktuella värdet av tilläggs marginalsäkerheten, kumulerat sedan den första rapporteringen av de tilläggs marginalsäkerheter som samlats in för portföljen eller transaktionen.</p>

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
			<p>Om den tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in är denominerad i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.</p>
24	Säkerhet	Tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in av motpart 1 (efter värderingsavdrag)	<p>Det monetära värdet av den tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in av motpart 1, inklusive den kontantreglerade marginalsäkerheten och eventuella marginalsäkerheter som är i transit och som är under avveckling. Villkorad tilläggsmarginalsäkerhet ingår inte.</p> <p>Om säkerheten ställs på portföljnivå avser den tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in hela portföljen. Om säkerheten ställs för enskilda transaktioner avser den tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in en sådan enskild transaktion.</p> <p>Detta fält avser det totala aktuella värdet av den insamlade tilläggsmarginalsäkerheten efter tillämpning av värderingsavdraget, i förekommande fall, kumulerat sedan den första rapporteringen av tilläggsmarginalsäkerheter som erhållits för portföljen/transaktionen.</p> <p>Om den tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in är denominerad i mer än en valuta räknas dessa belopp om till en enda valuta som väljs av motpart 1 och rapporteras som ett enda totalt värde.</p>

Post	Avsnitt	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in
25	Säkerhet	Valutan för den insamlade tilläggsmarginalsäkerheten	Valuta i vilken den insamlade tilläggsmarginalsäkerheten är denominerad. Om den tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in är denominerad i mer än en valuta återspeglar detta dataelement en av de valutor till vilka motpart 1 har valt att konvertera alla värden för de insamlade tilläggsmarginalsäkerheterna.
26	Säkerhet	Överskjutande säkerhet som samlats in av motpart 1	Det monetära värdet för eventuella ytterligare säkerheter som samlats in av motpart 1 separat och oberoende av initiala marginalsäkerheter och tilläggsmarginalsäkerheter. Detta dataelement avser den överskjutande säkerhetens totala aktuella värde före tillämpning av värderingsavdraget, i tillämpliga fall, snarare än dess dagliga förändring. Alla belopp för initiala marginalsäkerheter eller tilläggsmarginalsäkerheter som samlats in och som överstiger den initiala marginalsäkerhet som krävs eller den tilläggsmarginalsäkerhet som krävs, rapporteras som en del av den initiala marginalsäkerhet som samlats in respektive den tilläggsmarginalsäkerhet som samlats in i stället för som en del av den överskjutande säkerhet som samlats in. För centralt clearade transaktioner rapporteras överskjutande säkerheter endast i den mån de kan hänföras till en specifik portfölj eller transaktion.
27	Säkerhet	Valuta för den överskjutande säkerhet som samlats in	Valuta i vilken den överskjutande säkerhet som samlats in är denominerad. Om den överskjutande säkerheten är denominerad i mer än en valuta återspeglar detta dataelement en av de valutor till vilka motpart 1 har valt att konvertera alla värden för de insamlade överskjutande säkerheterna.

<b>Post</b>	<b>Avsnitt</b>	<b>Fält</b>	<b>Uppgifter som ska rapporteras in</b>
28	Säkerhet	Åtgärdstyp	Rapporten ska ange en av följande åtgärdstyper: a) Ett nytt marginalsäkerhetssaldo eller en ändring av uppgifterna om marginalsäkerheterna ska anges som "Uppdatering av marginalsäkerhet". b) En korrigering av datafält där uppgifter lämnats in felaktigt i en tidigare rapport ska anges som "Korrigera".
29	Säkerhet	Datum för händelsen	Datum då den händelse som ska rapporteras avseende derivatkontraktet och som tas upp i rapporten ägde rum. Vid uppdatering av säkerheter: det datum för vilket informationen i rapporten lämnas.