



European Securities and
Markets Authority

Iránymutatások

**Adatszolgáltatás az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet
4. és 12. cikke alapján**



Tartalomjegyzék

| | | |
|-------|--|----|
| 1 | Jogszabályi hivatkozások, rövidítések és fogalommeghatározások..... | 6 |
| 2 | Hatály..... | 8 |
| 3 | Cél | 8 |
| 4 | Általános elvek | 9 |
| 4.1 | Az adatszolgáltatás kezdő dátuma | 9 |
| 4.2 | Az adatszolgáltatás tárgyát képező értékpapír-finanszírozási ügyletek számának meghatározása | 10 |
| 4.2.1 | Az értékpapír-finanszírozási ügylet meghatározása alá nem tartozó piaci ügyletek | 10 |
| 4.2.2 | Az értékpapír-finanszírozási ügyletek valamennyi típusával kapcsolatos szempontok..... | 10 |
| 4.2.3 | A repoügyletekkel kapcsolatos szempontok | 12 |
| 4.2.4 | A vétel-eladás ügyletekkel (BSB)/eladás-visszavásárlás ügyletekkel (SBB) kapcsolatos szempontok | 12 |
| 4.2.5 | Az értékpapír-kölcsönzési vagy értékpapír-kölcsönvételi ügyletekkel kapcsolatos szempontok..... | 13 |
| 4.2.6 | Az árukra vonatkozó értékpapír-finanszírozási ügyletekkel kapcsolatos szempontok..... | 14 |
| 4.2.7 | Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelekkel kapcsolatos szempontok..... | 15 |
| 4.3 | A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekről való adatszolgáltatás..... | 16 |
| 4.4 | A felelősség megosztása az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikkének (3) bekezdése alapján | 17 |
| 4.4.1 | Általános eset..... | 17 |
| 4.4.2 | Harmadik ország – pénzügyi szerződő felek | 18 |
| 4.4.3 | Pénzalapok | 18 |
| 4.5 | Az adatszolgáltatási kötelezettség önkéntes átruházása | 18 |
| 4.6 | Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatási kötelezettségek alkalmazása a fióktelepek által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletekre | 19 |
| 4.6.1 | Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatási kötelezettségek alkalmazása az uniós fióktelepekkel rendelkező nem uniós szervezetek által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletek esetén | 19 |
| 4.6.2 | Az adatszolgáltatás tárgyát képező, fióktelepek által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletek meghatározása..... | 19 |
| 4.7 | Nem pénzügyi szerződő fél által végzett adatszolgáltatás | 21 |

| | | |
|--------|--|----|
| 4.8 | Intézkedéstípusok | 21 |
| 4.8.1 | Alkalmazható intézkedéstípusok | 21 |
| 4.8.2 | Az értékpapír-finanszírozási ügyletek módosításainak teljes pillanatképe, illetve részleges jelentése..... | 21 |
| 4.8.3 | Az intézkedéstípusok sorrendje a különböző típusú üzenetek esetében | 22 |
| 4.9 | Az értékpapír-finanszírozási ügylet megkötéséről, módosításáról és lezárásáról időben történő adatszolgáltatás | 26 |
| 4.9.1 | Értékpapír-finanszírozási ügylet megkötése | 26 |
| 4.9.2 | Értékpapír-finanszírozási ügylet módosítása és helyesbítése..... | 27 |
| 4.9.3 | Biztosítékok aktualizálása | 28 |
| 4.9.4 | Az értékelés, a letét és az újrafelhasználás aktualizálása | 29 |
| 4.9.5 | Értékpapír-finanszírozási ügylet lezárása | 29 |
| 4.9.6 | A adatszolgáltatási határidők adatszolgáltatás-típusonkénti és intézkedéstípusonkénti áttekintése | 30 |
| 4.10 | Az üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése | 31 |
| 4.11 | A központi értéktár résztvevőjének azonosítása..... | 39 |
| 4.12 | A szerződő fél minőségének meghatározása | 39 |
| 4.12.1 | Általános eset..... | 39 |
| 4.12.2 | A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek | 40 |
| 4.12.3 | Értékpapírok fedezetlen kölcsönbe adásáról/kölcsönbe vételéről való adatszolgáltatás | 40 |
| 4.12.4 | A szerződő fél minőségéről való adatszolgáltatás nettó kitettségi alapon nyújtott biztosíték esetén | 40 |
| 4.13 | Árral és értékkel kapcsolatos mezők | 40 |
| 4.13.1 | Az értékelések időzítése | 40 |
| 4.13.2 | Az értékelésekhez használt számítási módszerek..... | 41 |
| 4.14 | A CFI-kód jelentése biztosítékként használt értékpapír esetében..... | 41 |
| 4.15 | Visszamenőleges adatszolgáltatás..... | 42 |
| 4.16 | Egyedi ügyletazonosító létrehozása és felépítése | 42 |
| 4.17 | A kedvezményezettek azonosítása és jelentése | 44 |
| 4.18 | Az értékpapír-kibocsátó és az értékpapírok azonosítása..... | 45 |
| 4.19 | A szerződő fél vállalati esemény alanyává válásakor követendő eljárás..... | 45 |
| 4.20 | Adatszolgáltatás a fokozatos bevezetési időszakban | 47 |
| 5 | Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti mezők táblázatai..... | 47 |
| 5.1 | A szerződő fél adatai..... | 49 |

| | |
|--|----|
| Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITs management company delegates reporting to a third party | 51 |
| Non-cleared SFTs concluded by AIF | 51 |
| Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced..... | 51 |
| 5.1.1 El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügyletek a vállalatközpontok között | 51 |
| 5.1.2 El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet fióktelepek között | 53 |
| 5.1.3 El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet kedvezményezettekkel | 55 |
| 5.1.4 El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet brókerekkel, amelyet letétkezelő bank egyenlíti ki..... | 56 |
| 5.1.5 El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között | 58 |
| 5.1.6 El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig önkéntesen harmadik félre ruházzák át. | 60 |
| 5.1.7 Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között | 62 |
| 5.1.8 Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig harmadik félre ruházzák át. | 64 |
| 5.1.9 ÁÉKBV alap által kötött el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek..... | 67 |
| 5.1.10 ÁÉKBV alap által megkötött, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek, ahol az ÁÉKBV alapkezelő társaság harmadik félre ruházza át az adatszolgáltatást | 68 |
| 5.1.11 ABA által kötött, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek | 70 |
| 5.1.12 El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek, amelyek esetében az alap portfóliókezelését kiszervezik | 72 |
| 5.2 Hitel- és biztosítékadatok | 73 |
| 5.2.1 Az intézkedéstípusok ügylet- és pozíciószintű jelentése..... | 74 |
| 5.3 Hiteladatok | 85 |
| 5.3.1 Az esemény dátumának jelentése..... | 86 |
| 5.3.2 Elszámolt / el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletről való adatszolgáltatás | 86 |
| 5.3.3 Kereskedési helyszín | 93 |
| 5.3.4 Keretszerződés rész..... | 93 |
| 5.3.5 Az ügylet megkötése és kezdete | 96 |
| 5.3.6 Az értékpapír-finanszírozási ügylet futamideje | 97 |

| | | |
|--------|---|-----|
| 5.3.7 | A lezárás választhatósága..... | 99 |
| 5.3.8 | Általános és egyedi biztosítéki szerződések..... | 100 |
| 5.3.9 | Fix vagy változó kamatlábak | 103 |
| 5.3.10 | A repoügyletek és a vétel-eladás/eladás-visszavásárlás ügyletek tőkeösszege | 106 |
| 5.3.11 | Hiteloldal értékpapír-kölcsönzésnél | 107 |
| 5.3.12 | Értékpapírok..... | 108 |
| 5.3.13 | Árukat érintő értékpapír-finanszírozási ügyletek – áruk kölcsönbe adása..... | 113 |
| 5.3.14 | Értékpapírok pénzeszköz-fedezett kedvezményes kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele | 115 |
| 5.3.15 | Értékpapírok díjalapú kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele Értékpapírok nem pénzeszközökben nyújtott biztosítékkal fedezett kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele, értékpapírok számla-összevezetési kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele, valamint értékpapírok biztosítékeszközzel nem fedezett kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele .. | 116 |
| 5.3.16 | Értékpapírügylethez kapcsolódó hitel összege és rövid pozíciók piaci értéke.. | 117 |
| 5.4 | Biztosítéki adatok..... | 120 |
| 5.4.1 | Értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet biztosítékeszközökkel való fedezettségére vonatkozó adatszolgáltatás..... | 121 |
| 5.4.2 | Biztosítékkal való fedezettség | 121 |
| 5.4.3 | Pénzeszközben nyújtott biztosíték..... | 128 |
| 5.4.4 | Nulla biztosíték bejelentése..... | 129 |
| 5.4.5 | Az értékpapírokból álló biztosítékra vonatkozó mezők | 130 |
| 5.4.6 | Változó letét nyújtása ügyletszinten nem központilag elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében..... | 141 |
| 5.4.7 | Változó letét nyújtása nem központilag elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyleteknél nettó kitétség alapon történő, biztosítékkal való fedezés esetén..... | 150 |
| 5.4.8 | Előre kifizetett biztosíték értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylethez..... | 191 |
| 5.4.9 | Elszámolt ügyletek portfóliója | 193 |
| 5.5 | Letéti adatok..... | 193 |
| 5.5.1 | A központi szerződő fél a klíringtagként részt vevő két szerződő fél között helyezkedik el..... | 194 |
| 5.5.2 | A központi szerződő fél két olyan szerződő fél közé iktatja be magát, akik nem klíringtagok..... | 195 |
| 5.5.3 | A letétre vonatkozó információk bejelentése | 195 |
| 5.6 | Adatok újrafelhasználása, pénzeszközök újrabefektetése és finanszírozási források ... | 196 |
| 5.6.1 | Biztosíték újrafelhasználása | 197 |



| | | |
|-------|---|-----|
| 5.6.2 | Pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetése | 204 |
| 5.6.3 | Nincs nem pénzeszközben nyújtott biztosíték újrafelhasználása és pénzeszköz- újrabefektetés..... | 211 |
| 5.6.4 | Finanszírozási források | 212 |
| 6 | Elutasítási visszajelzés..... | 213 |
| 7 | Egyeztetési visszajelzés..... | 216 |
| 8 | Hiányzó biztosíték visszajelzés | 219 |
| 9 | Adatszolgáltatás a hatóságok számára | 219 |
| 9.1 | Határidő az adathozzáférés létrehozására | 219 |
| 9.2 | Működési megállapodások adathozzáféréshez | 220 |

1 Jogszabályi hivatkozások, rövidítések és fogalommeghatározások

Jogszabályi hivatkozások

| | |
|---|---|
| <i>ABAK-irányelv</i> | Az Európai Parlament és a Tanács 2011/61/EU irányelve (2011. június 8.) az alternatívbefektetésialap-kezelőkről |
| <i>Biztosítékokról szóló irányelv</i> | Az Európai Parlament és a Tanács 2002/47/EK irányelve (2002. június 6.) a pénzügyi biztosítékokról szóló megállapodásokról |
| <i>Fogyasztói hitelről szóló irányelv</i> | Az Európai Parlament és a Tanács 2008/48/EK irányelve (2008. április 23.) a fogyasztói hitelmegállapodásokról és a 87/102/EGK tanácsi irányelv hatályon kívül helyezéséről |
| <i>Adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardok</i> | A Bizottság (EU) 2019/363 végrehajtási rendelete (2018. december 13.) az (EU) 2015/2365 európai parlamenti és tanácsi rendeletnek megfelelően az értékpapír-finanszírozási ügyletekkel kapcsolatban a kereskedési adattárak felé teljesítendő adatszolgáltatás formátumára és gyakoriságára vonatkozó végrehajtás-technikai standardok megállapításáról, valamint az 1247/2012/EU bizottsági végrehajtási rendeletnek a származtatott ügyletekre vonatkozó adatszolgáltatáshoz használandó kódok tekintetében történő módosításáról |
| <i>EMIR</i> | Az európai piaci infrastruktúráról szóló rendelet – Az Európai Parlament és a Tanács 648/2012/EU rendelete (2012. július 4.) a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról |
| <i>PVR</i> | Az Európai Parlament és a Tanács 596/2014/EU rendelete (2014. április 16.) a piaci visszaélésekről (piaci visszaélésekről szóló rendelet) |
| <i>MiFIR</i> | Az Európai Parlament és a Tanács 600/2014/EU rendelete (2014. május 15.) a pénzügyi eszközök piacairól és a 648/2012/EU rendelet módosításáról |
| <i>MMSR</i> | 1333/2014/EU rendelet (2014. november 26.) a pénzpiacokra vonatkozó statisztikákról |
| <i>Jelzáloghitel irányelv</i> | Az Európai Parlament és a Tanács 2014/17/EU irányelve (2014. február 4.) a lakóingatlanokhoz kapcsolódó fogyasztói hitelmegállapodásokról, valamint a 2008/48/EK és a 2013/36/EU irányelv és az 1093/2010/EU rendelet módosításáról |



REMIT

Az Európai Parlament és a Tanács 1227/2011/EU rendelete (2011. október 25.) a nagykereskedelmi energiapiacok integritásáról és átláthatóságáról

Adatszolgáltatásról szóló szabályozástechnikai standardok

A Bizottság (EU) 2019/356 felhatalmazáson alapuló rendelete (2018. december 13.) az (EU) 2015/2365 európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az értékpapír-finanszírozási ügyletekkel kapcsolatos, kereskedési adattárak számára szolgáltatandó adatok meghatározására vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

Adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok

A Bizottság (EU) 2019/357 felhatalmazáson alapuló rendelete (2018. december 13.) az (EU) 2015/2365 európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az értékpapír-finanszírozási ügyletek kereskedési adattárakban tárolt adataihoz való hozzáférésre vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

Adatellenőrzésről szóló szabályozástechnikai standardok

A Bizottság (EU) 2019/358 felhatalmazáson alapuló rendelete (2018. december 13.) az (EU) 2015/2365 európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatok kereskedési adattárak általi gyűjtésére, ellenőrzésére, összesítésére, összehasonlítására és közzétételére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet

Az Európai Parlament és a Tanács (EU) 2015/2365 rendelete (2015. november 25.) az értékpapír-finanszírozási ügyletek és az újrafelhasználás átláthatóságáról, valamint a 648/2012/EU rendelet módosításáról (a továbbiakban: rendelet)

Technikai standardok

Az adatszolgáltatásról szóló szabályozástechnikai standardok ((EU) 2019/356 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet) és az adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardok ((EU) 2019/363 bizottsági végrehajtási rendelet)

ÁÉKBV

Az Európai Parlament és a Tanács 2009/65/EK irányelve (2009. július 13.) az átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozásokra (ÁÉKBV) vonatkozó törvényi, rendeleti és közigazgatási rendelkezések összehangolásáról

2 Hatály

Alanyi hatály

1. Ezek az iránymutatások az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 3. cikke (2) bekezdésében meghatározott, értékpapír-finanszírozási ügyletekben részt vevő szerződő felekre, az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 3. cikkének (1) bekezdésében meghatározott kereskedési adattárakra és az illetékes hatóságokra vonatkoznak.

Tárgyi hatály

2. Ezek az iránymutatások az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikkében előírt, értékpapír-finanszírozási ügyletekkel kapcsolatos adatszolgáltatási kötelezettségre, az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 5. cikkének (7) bekezdése és 12. cikke szerinti, kereskedési adattárakkal kapcsolatos kötelezettségekre, valamint az adatszolgáltatást illetően az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 33. cikkének (2) bekezdésében meghatározott kezdő időpontra vonatkoznak.

Időbeli hatály

3. Ezek az iránymutatások az ESMA honlapján való közzétételüket követő naptól, vagy attól a naptól kezdve alkalmazandók, amikor az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 33. cikkének (2) bekezdése szerint a szervezetekre vonatkozó rendelkezéseket alkalmazni kell, amelyik dátum később következik be.
4. A szerződő feleket, az adatszolgáltatásért felelős szervezeteket és az adatszolgáltatást végző szervezeteket arra bátorítjuk, hogy az iránymutatásokat az első naptól kezdve használják, ahogy a vonatkozó adatszolgáltatási kötelezettség az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 33. cikke (2) bekezdésének a) pontja szerinti alkalmazandóvá válik.

3 Cél

5. Ezen iránymutatások az ESMA rendelet 16. cikkének (1) bekezdésén alapulnak. Ezen iránymutatások célja az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet számos rendelkezésének tisztázása és gyakorlati útmutatás nyújtása e rendelkezések némelyikének végrehajtására nézve. Az iránymutatások hozzá fognak járulni a költségek csökkentéséhez a teljes adatszolgáltatási lánc mentén – az adatszolgáltatást teljesítő szerződő felek, az adatok teljességének és helyességének ellenőrzésére szolgáló eljárásokat bevezető kereskedési adattárak, valamint az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 12. cikkének (2) bekezdésében meghatározott, az adatokat a pénzügyi stabilitást fenyegető kockázatok felügyelete céljából felhasználó hatóságok körében is. Az iránymutatások a következő szempontokat tisztázzák:

- a. az adatszolgáltatás kezdő dátuma, ha az nem munkanapra esik;
- b. az adatszolgáltatás tárgyát képező értékpapír-finanszírozási ügyletek száma;

- c. a különféle típusú értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatszolgáltatási mezők kitöltése;
- d. az értékpapír-finanszírozási ügylet biztosítékának az értékpapír-finanszírozási ügyletkez kapcsolódó hitelekkel való összekapcsolására alkalmazott megközelítés;
- e. a letéti adatokra vonatkozó adatszolgáltatási mezők kitöltése;
- f. az újrafelhasználásra, újrabefektetésre és a finanszírozási forrásokra vonatkozó adatszolgáltatási mezők kitöltése;
- g. a kereskedési adattárak által adott visszajelzés és annak szerződő felek általi későbbi kezelése, nevezetesen i. a szolgáltatott adatok elutasítása és ii. egyeztetési eltérések esetén; és
- h. a kereskedési adattárak által az adatokhoz való hozzáférés biztosítása a hatóságok számára.

4 Általános elvek

4.1 Az adatszolgáltatás kezdő dátuma

- 6. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikkének (1) bekezdése szerinti adatszolgáltatási kötelezettséget az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 33. cikke (2) bekezdése a) pontjának i. alpontjában meghatározott alkalmazás szempontjából releváns időpontnak megfelelően kell alkalmazni. A kötelezettség első szakasza 2020. április 11-én válik alkalmazandóvá, amely szombatra esik. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikke (1) bekezdésének értelmében a szerződő feleknek legkésőbb az ügylet megkötését, módosítását vagy lezárását követő munkanapon kell teljesíteniük adatszolgáltatási kötelezettségüket.
- 7. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 33. cikke (2) bekezdése a) pontjának i. alpontjában említett azon szervezeteknek, amelyek székhelye olyan uniós tagállamaiban található, ahol április 13. nem munkaszüneti nap, azaz munkanap, a 2020. április 11. napján vagy azt követően kötött értékpapír-finanszírozási ügyletek tekintetében 2020. április 13-ával kell megkezdeniük az adatszolgáltatást.
- 8. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 33. cikke (2) bekezdése a) pontjának i. alpontjában említett azon szervezeteknek, amelyek székhelye olyan uniós tagállamaiban található, ahol április 13. munkaszüneti nap, azaz nem munkanap, a 2020. április 11. napján vagy azután kötött értékpapír-finanszírozási ügyletek tekintetében 2020. április 14-ével kell megkezdeniük az adatszolgáltatást.
- 9. Ugyanezt a megközelítést kell alkalmazni az adatszolgáltatási kötelezettséggel kapcsolatos többi alkalmazási időpont esetében is.

4.2 Az adatszolgáltatás tárgyát képező értékpapír-finanszírozási ügyletek számának meghatározása

10. Az adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardok 1. cikkének (1) bekezdése szerint a szerződő feleknek az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatszolgáltatásaikat egységes, elektronikus és gép által olvasható formában, általános XML-formátumú, az ISO 20022 szabvány szerint kidolgozott sablonfájlban kell rendelkezésre bocsátaniuk. Ennek megkönnyítése érdekében ezen iránymutatások tartalmazzák a különböző felhasználási esetekben alkalmazandó vonatkozó XSD összetevőt.

4.2.1 Az értékpapír-finanszírozási ügylet meghatározása alá nem tartozó piaci ügyletek

11. A következő ügyletek nem tartozhatnak az értékpapír-finanszírozási ügylet meghatározása alá, és azokról nem kell adatot szolgáltatni az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerint:

- a. lakossági hitelezés, amelyet a fogyasztói hitelről szóló jogszabályok szabályoznak;
- b. az értékpapír-finanszírozással össze nem függő magánbanki és lombard hitelek;
- c. szindikált hitelezés és egyéb, kereskedelmi célú vállalati hitelezés;
- d. letétkezelők folyószámlahitelei és központi szerződő felek napközbeni hiteleszközei;
- e. megíúsulást orvosló napközbeni hitel / folyószámlahitel;
- f. a központi bank automatikus biztosítékai;
- g. pozícióátadások és pozícióátvételek a végrehajtási és elszámolási láncban;
- h. működési és/vagy iparági célokra megkötött áruügyletek;
- i. kibocsátási egységeket érintő ügyletek.

4.2.2 Az értékpapír-finanszírozási ügyletek valamennyi típusával kapcsolatos szempontok

12. Az értékpapír-finanszírozási ügyletben részes azon felet, aki saját számlára történő ügyletkötéssel, megbízóként jár el, az értékpapír-finanszírozási ügylet szerződő felének kell tekinteni.

13. Az olyan szervezetet, amely elősegíti, megszervezi az értékpapír-finanszírozási ügyletet vagy egyéb módon részt vesz abban, de nem megbízóként és nem is saját számlára – akár a hitelezési, akár a biztosítéki oldalon –, és egy ügyfél nevében jár el, nem szabad szerződő félként meghatározni, hanem az adott helyzettől függően brókerként, ügynök hitelezőként, háromoldalú ügynökként vagy a központi értéktár kiegyenlítési rendszerében részt vevő félként határozható meg. Egy szervezet több szerepkört is betölthet egy értékpapír-finanszírozási ügyletben. A szerződő felek adatainak konkrét megadását az 5.1. szakasz határozza meg részletesen.

14. Ezért a szerződő felek kötelesek meghatározni, hogy milyen típusú értékpapír-finanszírozási ügyletet kötöttek. Hasonlóképpen, amint azt az adatszolgáltatásról szóló szabályozástechnikai standard 1. melléklete és az 5.2. szakasza részletezi, nem minden mező alkalmazható valamennyi értékpapír-finanszírozási ügylet esetében, ezért a szerződő feleknek kétséget kizáróan meg kell állapodniuk a megkötött értékpapír-finanszírozási ügylet típusáról.
15. Az értékpapír-finanszírozási ügyletről akkor kell adatot szolgáltatni, ha abban két szerződő fél vesz részt, vagy ha az értékpapír-finanszírozási ügylet egyik szerződő fele olyan magánszemély, aki nem vállalkozás, a másik pedig az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendeletben meghatározott szerződő fél. Nem létezik olyan értékpapír-finanszírozási ügylet, amelyben kettőnél több szerződő fél szerepel. A hitelek kettő vagy több biztosítékkérő és kettő vagy több biztosítéknyújtó közötti felosztása esetén az értékpapír-finanszírozási ügylet úgy határozható meg, mint két szerződő fél közötti, egyes biztosítékeszközökkel fedezett értékpapír-, készpénz- vagy áruhitel.
16. A 12. bekezdésben foglalt feltételek teljesülése esetén a befektetési alapokat jogi természetüktől függetlenül az értékpapír-finanszírozási ügyletben részt vevő szerződő félnek kell tekinteni. Konkrétabban, a részalapok esetében – hasonlóan az EMIR keretében végzett tevékenységekhez – a részalapok általában rendelkeznek jogalanyazonosítóval. Ebben az esetben önállóan, szerződő félként kell adatot szolgáltatni. A kölcsönökkel és biztosítékokkal kapcsolatos releváns információknak az adott részalap által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletekre kell vonatkozniuk. Ha a részalap nem szerződő fél az értékpapír-finanszírozási ügyletben, olvassa el a 4.17. szakaszt.
17. Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a központi szerződő fél, annak klíringtagjai és azok ügyfelei stb. közötti minden értékpapír-finanszírozási ügylet különálló értékpapír-finanszírozási ügyletet képez, és különálló egyedi ügyletazonosítóval kell róla adatot szolgáltatni. Ha az értékpapír-finanszírozási ügyletet egy kereskedési helyszínen megkötik és ugyanazon a napon számolják el az adatszolgáltatásról szóló szabályozástechnikai standardok 2. cikke (2) bekezdésének rendelkezéseivel összhangban, akkor arról az elszámolás után kell adatot szolgáltatni, azaz a közbenső pozícióátadásokról és pozícióátvételekről nem kell adatot szolgáltatni. Az elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekről történő adatszolgáltatással kapcsolatos részletes információkért lásd a 4.3. szakaszt.
18. Ezen túlmenően megghiúsulást orvosló értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a központi értéktárnak szerződő félként a központi értéktár kiegyenlítési rendszerében részt vevő feleket kell jelentenie, nem pedig azok ügyfeleit. Ez akkor is alkalmazandó, ha az értékpapír-finanszírozási ügyletet egy omnibusz számlával szemben hajtják végre,
19. Ezért az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 2. cikkének (3) bekezdésében szereplő ügyleteket és a 4.2.1. szakaszban említett ügyleteket kivéve az összes többi értékpapír-finanszírozási ügyletről a ezen iránymutatások következő szakaszában leírtak szerint kell adatot szolgáltatni.
20. Érdemes megjegyezni, hogy a 2. cikk (3) bekezdésében említett értékpapír-finanszírozási ügyletekről a 600/2014/EK rendelet szerint kell adatot szolgáltatni.

4.2.3 A repoügyletekkel kapcsolatos szempontok

21. Egnél több pénznemben lévő biztosítékkal fedezett hitelek esetén ezek külön értékpapír-finanszírozási ügyleteket képeznek, és azokról külön egyedi ügyletazonosítókkal kell adatot szolgáltatni. Az egyes repoügyletekről a repoügyletről történő adatszolgáltatás általános elveivel összhangban kell adatot szolgáltatni:
 - a. minden egyes pénznem vonatkozásában szolgáltatson adatot a vonatkozó tőkeösszegekről, az egyedi ügyletazonosítóról és az egyes biztosíték-összetevőkről, ha vannak ilyenek; és
 - b. szolgáltatson adatot a nettó kitettség alapon nyújtott vonatkozó biztosítékról, azaz arról, amely fedezi a repoügyleteket, de egyikükhöz sincs konkrétan hozzárendelve, és biztosítsa, hogy összekapcsolható legyen a releváns mezőkön keresztül.
22. Ha a visszavásárlási ár más pénznemben van kifejezve, mint a vásárlási ár, de ettől függetlenül ugyanahhoz a repoügylethez kapcsolódik, akkor az árra és a tőkeösszege vonatkozó releváns információkról való adatszolgáltatáshoz a lejáró láb pénznemét az induló láb pénznemére kell átváltani. Kérjük, a piaci értékekről való adatszolgáltatáskor vegye figyelembe a devizaárfolyamok használatára vonatkozó, 4.13.1. szakaszban található iránymutatást annak biztosítása érdekében, hogy ebbe a mezőbe következetesen kiszámolt számadat kerüljön.
23. Ha a repoügylet biztosítéka más átruházási formát ölt, amely ettől függetlenül része a biztosítékokról szóló irányelvben meghatározott biztosítékmegállapodásoknak, a szerződő feleknek továbbra is repoügyletként kell arról adatot szolgáltatniuk. A más jogrendszerek szabályai szerint kötött repoügyletekről – például a Gentan repoügyletekről – ennek megfelelően kell adatot szolgáltatni, valamint az adatszolgáltatásról szóló technikai standardoknak megfelelően hiánytalan és pontos információkkal kell szolgálni.
24. A központi szerződő felek által kötött olyan repoügyletek és fordított repoügyletek, amelyek célja i. saját eszközök befektetése likviditásfenntartás céljából, vagy ii. klíringtagok letétként biztosított eszközeinek befektetése, az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikke szerinti adatszolgáltatási kötelezettség hatálya alá tartoznak.
25. A repoügyletekről és a fordított repoügyletekről a repoügyletekre vonatkozó, ISO 20022 szabvány szerint kidolgozott, XML-formátumú sablonfájl használatával kell adatot szolgáltatni.

4.2.4 A vétel-eladás ügyletekkel (BSB)/eladás-visszavásárlás ügyletekkel (SBB) kapcsolatos szempontok

26. Bizonyos vétel-eladás ügyleteket/eladás-visszavásárlás ügyleteket kétoldalú vagy keretmegállapodások szabályozzák. Az ezen értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó külön mellékletek azonban különböznek a repoügyletekre és a fordított repoügyletekre vonatkozó mellékletektől. Kétségtelen, hogy a megkötött értékpapír-finanszírozási ügylet típusa vétel-eladás ügylet/eladás-visszavásárlás ügylet.
27. Ha a vétel-eladás ügyleteket/eladás-visszavásárlás ügyleteket kétoldalú vagy keretmegállapodás, vagy egy keretmegállapodás melléklete szabályozza, erről a

megállapodásról a vonatkozó mezőkben kell adatot szolgáltatni, nevezetesen a hitel- és biztosítékadatokra vonatkozó 2. táblázat 9–11. mezőjében.

28. A szerződő feleknek arra kell törekedniük, hogy pontosan ugyanolyan módon szolgáltatassanak adatot az adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardokban nem szereplő keretmegállapodásokról. A keretmegállapodás vonatkozásában az éppen megkötött értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó verziót is jelteni kell a „Keretmegállapodás verziója” mezőben.
29. Ha a szerződő felek úgy találják, hogy a vétel-eladás ügyletek/eladás-visszavásárlás ügyletek bizonyos típusairól a repoügyletekre vonatkozó sablonfájl használatával jobban lehet adatot szolgáltatni, akkor – amennyiben ezzel mindkét szerződő fél egyetért – a szerződő feleknek a repoügyletekre vonatkozó sablonfájl használatával kell ezen értékpapír-finanszírozási ügyletekről adatot szolgáltatniuk.
30. A vétel-eladás ügyletekről/eladás-visszavásárlás ügyletekről a azokra vonatkozó ISO 20022 szabvány szerint kidolgozott, XML-formátumú sablonfájl használatával kell adatot szolgáltatni.

4.2.5 Az értékpapír-kölcsönzési vagy értékpapír-kölcsönvételi ügyletekkel kapcsolatos szempontok

31. A fogalom meghatározásból következik, hogy az értékpapír-kölcsönzési ügylet megkötése összekapcsolódik az értékpapíroknak a kölcsönadó részéről a kölcsönvevő részére történő átruházásával. Az értékpapír-kölcsönzési ügylet keretében nem kerülhet sor egynél több ISIN átadására. Ha harmadik fél szervezetek, például kölcsönnyújtó ügynökök általi allokáció során több ISIN-t kell átadni egy adott szerződő fél pár között, akkor minden egyes ISIN-hez külön értékpapír-finanszírozási ügyletet kell bejelenteni.
32. Mivel az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikkének (1) bekezdése értelmében legkésőbb a következő munkanapon adatot kell szolgáltatni az értékpapír-finanszírozási ügyletek megkötéséről, módosításáról és lezárásáról, az összes megkötött értékpapír-finanszírozási ügyletről adatot kell szolgáltatni. Ez magában foglalja az összes létrehozott értékpapír-finanszírozási ügyletet, még akkor is, hogy azok elszámolására esetleg még nem került sor.
33. A különféle bemutatott forgatókönyvek nem vették figyelembe az eszközkészletek bizonyos típusait. Ide tartoznak az olyan alapok is, amelyek az értékpapírokat egy eszközkészletben egyesítik, és kölcsönadhatják azokat. Ezek az alapok egy brókeren keresztül kereskednek, amely ügynökként jár el, és az alapok eszközkészletéből adott mennyiségű értékpapírt kölcsönöz. A közvetlen ügyletet a szerződő fél és az eszközkészlet között erősítik meg. A nap végén megtörténik a végső allokáció, és egyedi megerősítést küldenek az eszközkészletben részt vevő minden egyes alapnak. A részleteket a szerződő félnek is megküldik, a kiegyenlítésre pedig az érintett alapok közös letétkezelőjéből történő egyetlen átutalással kerül sor. Ebben az esetben – a 15. bekezdésben foglalt általános elvet követve – minden egyes szerződő fél pár és ISIN esetében a szerződő feleknek külön értékpapír-finanszírozási ügyletről kell adatot szolgáltatniuk a kereskedési adattárak számára.

34. Az eszközkészlettel rendelkező központi szerződő fél általi értékpapír-kölcsönzés esetén nem lehetséges adatot szolgáltatni a napközbeni életciklus-tevékenységről, ha a nap végén csak a nettó új hitelpozíciókatallokálják a kölcsönvevő és a kölcsönnyújtó részére. Következésképpen ugyan központi szerződő fél rendszerén belül adatot kell szolgáltatni a napközbeni kölcsönökről, előfordulhat, hogy azokhoz nem feltétlenül rendeltek biztosítékot. A biztosítékokról minden egyéb értékpapír-kölcsönzési ügylet esetében adatot kell szolgáltatni, ha a (2.72.) „Biztosítékeszközzel nem fedezett értékpapír-kölcsönzés jelzése” mezőben „hamis” érték szerepel; például a elszámolt nettó új kölcsönökről is adatot kell szolgáltatni a kereskedési jelentésben (az S+1. napon).
35. Az értékpapír-kölcsönzési ügyletekről az értékpapír-kölcsönzési ügyletekre vonatkozó, ISO 20022 szabvány szerint kidolgozott, XML-formátumú sablonfájl használatával kell adatot szolgáltatni.
36. A készpénzvezérelt értékpapír-kölcsönzési ügyletekről, más néven „fordított értékpapír-kölcsönökről” repoügyletként kell adatot szolgáltatni. Meg kell jegyezni, hogy amennyiben a készpénzvezérelt értékpapír-kölcsönzési ügyletről a repoügyletekre vonatkozó mezőket használva szolgáltatnak adatot, a keretmegállapodás típusának tükröznie kell a vonatkozó mögöttes megállapodást, pl. GMSLA.

4.2.6 Az árukra vonatkozó értékpapír-finanszírozási ügyletekkel kapcsolatos szempontok

37. Az értékpapír-finanszírozási ügylet végrehajtását oly módon kell felépíteni, hogy a haszonhúzó se az áruk gazdasági tulajdonjogát ne veszítse el, se új piaci kockázatot ne vállaljon az áruk vonatkozásában.
38. Az árukkal kapcsolatos repoügyleteket/fordított repoügyleteket egy (visszavásárlási) megállapodás megléte jellemzi. Az áruk átruházhatók kifejezett tulajdonjog-átruházás vagy zálogjogba adás útján.
39. Ha azonban – az árukra vonatkozó értékpapír-finanszírozási ügyletek hatóköréhez ragaszkodva – az eladás és visszavásárlás nem minősül repoügyletnek, akkor annak vétel-eladás ügyletnek kell lennie.
40. Áruk kölcsönbe adása vagy kölcsönbe vétele (SLB) során a biztosíték átvevője az a fél, amely az árukat kölcsönadja, a biztosíték nyújtója pedig az, amely az árukat kölcsönveszi. Ez eltér a repoügylettől/fordított repoügylettől és a vétel-eladás ügylettől/eladás-visszavásárlás ügylettől, ahol az árut az ügylet biztosítékának kell tekinteni.
41. Az árukkal kapcsolatos értékpapír-finanszírozási ügyletekről való adatszolgáltatáskor a vonatkozó keretmegállapodások alapján a szerződő feleknek fel kell mérniük, hogy az általuk jelentett, árukra vonatkozó értékpapír-finanszírozási ügylet típusa mennyire illeszkedik az adott értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó mezőbe. Ez segíthet meghatározni, hogy az ügyletről áru kölcsönadási vagy kölcsönvételi ügyletként, illetve árukkal fedezett repoügyletként/eladás-visszavásárlás ügyletként vagy fordított repóként/vétel-eladás ügyletként kell adatot szolgáltatni.
42. Ezenkívül az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 3. cikkének (7)–(10) bekezdésében meghatározott valamennyi értékpapír-finanszírozási ügylet – az értékpapírügyletkez kapcsolódó hitelek kivételével – hivatkozást tartalmaz az áruk

értékpapír-finanszírozási ügylet részeként történő lehetséges felhasználására. A vétel-eladás ügylet/eladás-visszavásárlás ügylet az áruk felhasználását a két szerződő fél közötti (piaci közvetítő nélküli) vásárlásokra és későbbi eladásokra korlátozza, míg az áru kölcsönbe adására és kölcsönbe vételére irányuló ügyletek és a repoügyletek a tulajdonjog-átruházási és a zálogjogi megállapodásokat egyaránt lehetővé teszik. Ezért a szerződő feleknek a 2.20. „Biztosíték nyújtásának módja” mezőben adott esetben meg kell adniuk a biztosítéki megállapodás típusát.

43. Az árukat érintő értékpapír-finanszírozási ügyletek néha összetettebb struktúrák részét képezik, amelyek származékos eszközöket, például határidős ügyleteket és opciókat is tartalmazhatnak. A teljes struktúrának csak azon részeiről kell adatot szolgáltatni, amelyek az értékpapír-finanszírozási ügyletet képezik. Előfordulhat, hogy az ilyen struktúrákban használt származékos eszközökről az EMIR és/vagy a MIFID és/vagy a REMIT keretében kell adatot szolgáltatni.
44. Az egyenértékű árukról és a helyettesített árukról való adatszolgáltatás tekintetében az ESMA a következők kérdéseket tisztázza:
 - a. az egyenértékű áruk azonos típusú áruk, amelyek jellemzői és/vagy specifikációi hasonlóak, és amelyek a szerződéses megállapodás szerint helyettesíthetik az eredeti árukat a visszajuttatási szakaszban.
 - b. a helyettesített áruk olyan áruk, amelyeket biztosítékként kötöttek le azon termékek helyettesítésére, amelyeket eredetileg ugyanazon ügylet keretében kötöttek le biztosítékként.

4.2.6.1 Energiával kapcsolatos értékpapír-finanszírozási ügyletek

45. Egy adott ügylet (pl. földgáz visszaértékesítése zónák között (alternatív) finanszírozási célokkal) lehet REMIT alapján jelentendő ügylet T+30 jelentési időkerettel és egyidejűleg T+1 határidővel jelentendő értékpapír-finanszírozási ügylet is.
46. Ezért ha az ilyen típusú ügyletek kellően egyértelműek az áruk finanszírozására használt értékpapír-finanszírozási ügyletekként történő egyértelmű besorolásukhoz, akkor azokról a vonatkozó adatszolgáltatási sablonfájl alapján kell adatot szolgáltatni.

4.2.7 Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelekkel kapcsolatos szempontok

47. Elvárható, hogy csakis egyetlen értékpapírügylethez kapcsolódó hitelügylet álljon fenn minden egyes szerződő fél pár között egy adott időpontban, kivéve akkor, ha a szervezetek szerződésben egynél több bázispénznemben állapodtak meg, és az értékpapírügylethez kapcsolódó hiteleket ezek mindegyike vonatkozásában meghatározzák; ebben az esetben minden bázispénznemhez egy értékpapírügylethez kapcsolódó hitelügylet tartozik. Ez az értékpapír-finanszírozási ügylet az adott bázispénznemben minden értékpapírügylethez kapcsolódó hitelre vagy rövid pozíciók piaci értékére fog vonatkozni.
48. Értékpapírügylethez kapcsolódó hitelekhez egyedi ügyletazonosítókat csak akkor szabad létrehozni, ha a hitelkeretből legalább egyszer történt már lehívás. Azokban az esetekben, amikor elsődleges brókermegállapodást írtak alá, de a hitelkeretből még nem történt

lehívás, akkor nem kell adatokat szolgáltatni, mivel még nem történt értékpapír-finanszírozási ügylet.

49. Ha bármely időpontban mind az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel, mind a rövid pozíciók piaci értéke nullára esik, vagyis nem kerül sor készpénz- vagy értékpapírhitel nyújtására, akkor a kiemelt bróker által tartott ügyfélbiztosíték már nem értékpapír-finanszírozási ügylet kitettséget biztosít. Azt más, nem értékpapír-finanszírozási ügylettel kapcsolatos kötelezettségekre tartják. A kiemelt brókernek és az ügyfélnek i. abba kell hagynia a biztosítékról való adatszolgáltatást mindaddig, amíg nem áll fenn ismét értékpapírügylethez kapcsolódó hitellel vagy rövid pozíciók piaci értékével kapcsolatos kitettség, vagy ii. a készpénzbiztosítékról nulla értéken kell adatot szolgáltatni annak jelzése érdekében, hogy nincs biztosíték.
50. Az ügyletről nem az „ETRM” intézkedéstípussal, hanem a „MODI” intézkedéstípussal kell adatot szolgáltatni. Ebben az esetben a készpénzbiztosíték értékét nullának feltüntető biztosítékaktualizálási üzenetet (COLU) is kapni kell annak érdekében, hogy elkerüljék a használt biztosíték téves bemutatását. A nulla értékű biztosítékról való adatszolgáltatást lásd az 5.4.4. szakaszban.
51. Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelek esetében a szerződő feleknek nem kell adatot szolgáltatniuk az értékpapíroktól és készpénztől eltérő biztosíték-összetevőkről.
52. Az ügyfél rövid pozíciójának piaci értékéről való adatszolgáltatás nem alapulhat a kiemelt bróker könyvelési elszámolásán (vagyis az ügyletkötés vagy a kiegyenlítés időpontjában történő elszámoláson) (IAS 39.38 Pénzügyi instrumentumok: Megjelenítés és értékelés). A rövid pozíciók piaci értékéről a hitel és a biztosíték elszámolásáról való adatszolgáltatással azonos módon kell adatot szolgáltatni. Így a szerződő feleknek a rövid pozíciók piaci értékét a tervezett kiegyenlítés időpontja és a várhatóan átadásra kerülő értékpapírok alapján kell kiszámítaniuk.
53. Ezenkívül, ha az ügyfél kiemelt brókerszolgáltatási portfóliója nem jár értékpapírokkal való kereskedéssel, akkor az ilyen ügyfeleknek történő hitelnyújtásról való adatszolgáltatás semmilyen értékkel nem bír az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szempontjából, ezért azt kell kerülni annak érdekében, hogy megakadályozzuk a nagy mennyiségű irreleváns információ gyűjtését.

4.3 A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekről való adatszolgáltatás

54. A pozíciószintű adatszolgáltatás a központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozik, emellett választható és kiegészíti az ügyletszintű adatszolgáltatást. Pozíció szintű adatszolgáltatásokat bizonyos feltételek teljesülése esetén lehet benyújtani:
 - a. A jogi konstrukció olyan, hogy a kockázat pozíció szinten merül fel, a kereskedési jelentések mind olyan termékekre vonatkoznak, amelyek egymással helyettesíthetők, és az egyes ügyletek helyébe a pozíció lép. Ez az eset áll fenn,

¹ Lásd az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatásról szóló iránymutatásokra vonatkozó konzultációs dokumentum 84. bekezdését.

amikor novációra az egyes ügyletek nettósítása után kerül sor, a nettósított pozíció új szerződést eredményez, és ehhez új egyedi ügyletazonosítót hoznak létre. Ez lehet a helyzet például egy klíringtag és egy központi szerződő fél között.

- b. Az eredeti ügyletekről – ügyleti szinten – helyesen szolgáltatott adatot. Csak pozíciókról adatot szolgáltatni nem megengedett.
 - c. A pozícióra vonatkozó jelentésben szereplő közös mezőket befolyásoló egyéb eseményekről külön kell adatot szolgáltatni.
 - d. Az eredeti kereskedési jelentések (fenti b) pont) és az egyéb eseményekkel kapcsolatos jelentések (fenti c) pont) adott esetben elérték a megfelelő „élettartam vége állapotot”. Ezt úgy kell elérni, hogy korai felmondási üzeneteket küldenek, majd a nettó pozícióról új pozícióként vagy a meglévő pozíció aktualizálásaként szolgáltatnak adatot.
 - e. A pozícióról való adatszolgáltatás akkor történik helyesen, a szerződőfél-specifikus és az ügyleti adatokkal kapcsolatos összes mezőt, valamint adott esetben a letétre és a biztosíték újrafelhasználására vonatkozó mezők táblázatát is kitöltik.
55. E feltételek teljesülése esetén a későbbi aktualizálásokról való adatszolgáltatás – ideértve az értékelés aktualizálását, a biztosíték aktualizálását és az egyéb módosításokat, valamint életciklus-eseményeket – a pozícióról való adatszolgáltatás (pl. módosítások stb., megtartva az egyedi ügyletazonosító ugyanazon értékét a központi szerződő fél által elszámolt pozíción), nem pedig az eredeti ügyletekről/eseményekről való adatszolgáltatások céljából alkalmazható.
56. A pozíció szintű adatszolgáltatás azonosításához a saját egyedi ügyletazonosítót kell használni, amely az adott pozíció állandó azonosítója, azaz a pozíció semmilyen módosítását követően sem változik.
57. Megerősítjük, hogy a pozíció szintű adatszolgáltatás megvalósulásához az elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyleteket először ügyleti szinten „POSC” intézkedéstípusként kell jelenteni (még akkor is, ha ugyanazon a napon számolják el azokat), és csak ezt követően lehet az életciklus-eseményekről pozíció szinten adatot szolgáltatni. Kérjük, tanulmányozza át az 5.2.1. szakaszban található forgatókönyvet, amely bemutatja a pozíciószintű adatszolgáltatáshoz szükséges lépéseket.

4.4 A felelősség megosztása az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikkének (3) bekezdése alapján

4.4.1 Általános eset

58. A nem pénzügyi szerződő félnek kommunikálnia kell a pénzügyi szerződő féllel arra vonatkozóan, hogy kis méretű nem pénzügyi szerződő félnek minősül-e vagy sem, valamint tájékoztatnia kell a pénzügyi szerződő felet státuszában bekövetkező esetleges változásokról.

4.4.2 Harmadik ország – pénzügyi szerződő felek

59. Amikor az Európai Bizottság bejelenti egy adott harmadik ország egyenértékűségét, abban az esetben, ha egy uniós fiókteleppel rendelkező harmadik országbeli pénzügyi szerződő fél és egy kkv nem pénzügyi szerződő fél között értékpapír-finanszírozási ügylet jött létre, amelynek keretében a harmadik országbeli pénzügyi szerződő fél és a kkv nem pénzügyi szerződő fél teljesítette az adott harmadik országban előírt adatszolgáltatási kötelezettségeit, sem a harmadik országbeli pénzügyi szerződő félnek, sem a kkv nem pénzügyi szerződő félnek nem kell adatot szolgáltatnia az értékpapír-finanszírozási ügyletről az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet alapján.
60. Az olyan értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében, amelyek az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet alkalmazási körén kívül eső (azaz az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 2. cikke (1) bekezdése a) pontjának ii. alpontja alá nem tartozó) harmadik országbeli pénzügyi szerződő fél és egy kkv nem pénzügyi szerződő fél között jönnek létre, az ilyen értékpapír-finanszírozási ügyletekről vagy közvetlenül a kkv nem pénzügyi szerződő félnek kell adatot szolgáltatnia a kereskedési adattár részére, vagy ellenkező esetben élnie kell a 4. cikk (2) bekezdésében foglalt feladatátruházási lehetőséggel.

4.4.3 Pénzalapok

61. Ha az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikkének (3) bekezdése szerinti felelősségmegosztás nem alkalmazható az ABAK-ra, vagyis az ABAK nem tartozik az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet hatálya alá, az értékpapír-finanszírozási ügyletekről a kereskedési adattár részére történő adatszolgáltatás felelőssége továbbra is az alapot terheli.

4.5 Az adatszolgáltatási kötelezettség önkéntes átruházása

62. Az adatszolgáltatás feladatának átruházása esetén az átruházó szerződő félnek (akire az adatszolgáltatási kötelezettség vonatkozik) kellő időben az adatszolgáltatást végző szervezet rendelkezésére kell bocsátania az értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó összes részletes adatot, és a szerződő fél felel annak biztosításáért, hogy ezek az adatok helytállóak legyenek. Ugyanakkor az adatszolgáltatást végző szervezetnek biztosítania kell, hogy az adatszolgáltató szerződő felek tájékoztatást kapjanak a nevükben szolgáltatott adatokról, a vonatkozó kereskedési adattári adatfeldolgozási eredményekről és a releváns adatszolgáltatási vagy adatminőségi problémákról, ha azok felmerülnek.

4.6 Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatási kötelezettségek alkalmazása a fióktelepek által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletekre

4.6.1 Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatási kötelezettségek alkalmazása az uniós fióktelepekkel rendelkező nem uniós szervezetek által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletek esetén

63. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet céljával és az EMIR-rel összhangban az ESMA úgy ítéli meg, hogy a megkötés kifejezést úgy kell értelmezni, hogy az az ügylet szerződő felére, azaz arra a szerződő félre vonatkozik, ahol az értékpapír-finanszírozási ügyletet könyvelik.

4.6.2 Az adatszolgáltatás tárgyát képező, fióktelepek által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletek meghatározása

64. Az 1. táblázat ismerteti, hogy miről kell adatot szolgáltatni az adatszolgáltató szerződő felek fióktelepeire hivatkozva.

65. Az „Értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet alapján jelentendő” című utolsó oszlop arra utal, hogy az ügyletre vonatkozik-e az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatási kötelezettség. Ha az ügylet nem képezi adatszolgáltatás tárgyát, akkor a szerződő felek/fióktelepek helyétől függetlenül arról nem kell adatot szolgáltatni. Az 1. táblázat piros sorai olyan forgatókönyveket mutatnak be, amelyekről az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet alapján soha nem kell adatot szolgáltatni.

66. Fontos megérteni, hogy bizonyos forgatókönyvek esetén az adatszolgáltatási kötelezettség fennállása a szerződő fél vonatkozásában nem jelenti azt, hogy az értékpapír-finanszírozási ügyletről adatot kell szolgáltatni, és ez fordítva is így van, amint azt az 1. táblázat ismerteti. Például az ugyanazon jogi személy két fióktelepe között megkötött ügyletekről még akkor sem kell adatot szolgáltatni, ha a (LEI 1 azonosítóval azonosított) szerződő félre az utolsó oszlopban meghatározottak szerint adatszolgáltatási kötelezettség vonatkozik. Ennek az az oka, hogy ebben az esetben nem két szerződő félről van szó, hanem ugyanazon fél két kiterjesztéséről.

67. Még ha egy fióktelep rendelkezik is LEI azonosítóval, az 1.3. „Adatszolgáltató szerződő fél” és az 1.11. „Másik szerződő fél” mezőbe a releváns vállalkozás LEI azonosítóját kell megadni, míg az érintett fióktelep adatait az 1.17. „Adatszolgáltató szerződő fél fióktelepe” és az 1.8. „Másik szerződő fél fióktelepe” mezőben kell megadni. Az 1.12. „Másik szerződő fél országa” mezőbe a vállalkozás országkódját kell beírni, nem a fióktelepét.

1. táblázat – Fióktelepenkénti adatszolgáltatás

| | Reporting Counterparty | Country of the reporting counterparty | Country of the branch of the reporting counterparty | Reporting obligation | Other Counterparty | Country of the other counterparty | Country of the branch of the other counterparty | Reporting obligation | Reportable under SFTR |
|-------|------------------------|---------------------------------------|---|----------------------|--------------------|-----------------------------------|---|----------------------|-----------------------|
| SFT1 | LEI1 | EU | | YES | LEI1 | EU | AT | YES | NO |
| SFT2 | LEI1 | EU | | YES | LEI1 | EU | US | YES | NO |
| SFT3 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI1 | EU | AT | YES | NO |
| SFT4 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI1 | EU | US | YES | NO |
| SFT5 | LEI1 | EU | CH | YES | LEI1 | EU | US | YES | NO |
| SFT6 | LEI1 | EU | | YES | LEI2 | EU | | YES | YES |
| SFT7 | LEI1 | EU | | YES | LEI2 | EU | AT | YES | YES |
| SFT8 | LEI1 | EU | | YES | LEI2 | EU | US | YES | YES |
| SFT9 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI2 | EU | | YES | YES |
| SFT10 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI2 | EU | AT | YES | YES |
| SFT11 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI2 | EU | US | YES | YES |
| SFT12 | LEI1 | EU | US | YES | LEI2 | EU | | YES | YES |
| SFT13 | LEI1 | EU | US | YES | LEI2 | EU | AT | YES | YES |
| SFT14 | LEI1 | EU | US | YES | LEI2 | EU | US | YES | YES |
| SFT15 | LEI1 | EU | | YES | LEI3 | US | | NO | YES |
| SFT16 | LEI1 | EU | | YES | LEI3 | US | CH | NO | YES |
| SFT17 | LEI1 | EU | | YES | LEI3 | US | AT | YES | YES |
| SFT18 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI3 | US | | NO | YES |
| SFT19 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI3 | US | CH | NO | YES |
| SFT20 | LEI1 | EU | BE | YES | LEI3 | US | AT | YES | YES |
| SFT21 | LEI1 | EU | US | YES | LEI3 | US | | NO | YES |
| SFT22 | LEI1 | EU | US | YES | LEI3 | US | CH | NO | YES |
| SFT23 | LEI1 | EU | US | YES | LEI3 | US | AT | YES | YES |
| SFT24 | LEI4 | US | | NO | LEI3 | US | | NO | NO |
| SFT25 | LEI4 | US | AT | YES | LEI3 | US | | NO | YES |
| SFT26 | LEI4 | US | CH | NO | LEI3 | US | | NO | NO |
| SFT27 | LEI4 | US | | NO | LEI3 | US | AT | YES | YES |
| SFT28 | LEI4 | US | AT | YES | LEI3 | US | AT | YES | YES |
| SFT29 | LEI4 | US | CH | NO | LEI3 | US | AT | YES | YES |
| SFT30 | LEI4 | US | | NO | LEI3 | US | CH | NO | NO |
| SFT31 | LEI4 | US | AT | YES | LEI3 | US | CH | NO | YES |
| SFT32 | LEI4 | US | CH | NO | LEI3 | US | CH | NO | NO |

Note: AT and BE are ISO 3166-1 Alpha-2 codes for EU member states, US and CH are ISO 3166-1 Alpha-2 codes for non-EU member states.

All codes are included for illustrative purposes.

If the country of the branch is not provided, it should be interpreted that the SFT was concluded by the headquarters.

The reporting of the data elements in italics might not be required.

4.7 Nem pénzügyi szerződő fél által végzett adatszolgáltatás

68. Az ESMA elismeri, hogy egyes forgatókönyvek esetén nem áll rendelkezésre LEI; ez a forgatókönyv azonban nem vonatkozik az EU-ban székhellyel rendelkező nem pénzügyi szerződő felekre. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet hatálya alá tartozó minden szervezetnek a LEI használatával kell azonosítania a vonatkozó adatmezőkben említett szervezeteket.
69. Amikor az értékpapír-finanszírozási ügylet két nem pénzügyi szerződő fél között jön létre, arról mindkét félnek adatot kell szolgáltatnia a kereskedési adattár részére, bár élhetnek azzal a lehetőséggel, hogy a 4. cikk (2) bekezdése szerinti adatszolgáltatást egyikükre vagy harmadik félre ruházzák át.

4.8 Intézkedéstípusok

4.8.1 Alkalmazható intézkedéstípusok

70. Az értékpapír-finanszírozási ügyletben részt vevő szerződő feleknek adatot kell szolgáltatniuk az értékpapír-finanszírozási ügyletek megkötéséről, módosításáról és lezárásáról. Ha az értékpapír-finanszírozási ügylet adatmezőkben megadott részletes adatai közül egy sem változott, akkor a szerződő feleknek nem kell újból adatot szolgáltatniuk az értékpapír-finanszírozási ügylet részleteiről.
71. Az értékelés aktualizálásáról csak akkor kell adatot szolgáltatni, ha a kölcsönbe adott vagy biztosítékként használt értékpapírok értéke megváltozik.
72. Biztosítékokról való adatszolgáltatás esetén a szerződő feleknek a biztosítékban napközben bekövetkezett változásokról nem kell adatot szolgáltatniuk, hanem csak a nap végi állapotról.
73. Az intézkedéstípusok kölcsönösen kizárják egymást. A egyes különféle intézkedéstípusokhoz kapcsolódó adatszolgáltatás eltérő információkat hordoz a hatóságok számára mind üzleti, mind adatkezelési szempontból. Ezért a szerződő feleknek törekedniük kell a helyes intézkedéstípus jelentésére.

4.8.2 Az értékpapír-finanszírozási ügyletek módosításainak teljes pillanatképe, illetve részleges jelentése

74. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó módosítások – mind az életciklus-események, mind a helyesbítések – esetében a szerződő feleknek olyan üzeneteket kell beküldeniük, amelyek az összes alkalmazandó mezőt tartalmazzák, beleértve azokat is, amelyek nem változtak meg, továbbra is lehetővé téve a kölcsönrel és a biztosítékokkal kapcsolatos külön adatszolgáltatást.
75. Ezenkívül meg kell jegyezni, hogy az értékelés, a biztosíték, a letét és az újrafelhasználás aktualizálása napi pillanatkép jellegű adatszolgáltatás formájában történik, és ebben esetben minden releváns mezőt ki kell tölteni. Ezenkívül a napi adatszolgáltatásra tekintettel elvárható, hogy ezek a pillanatkép jellegű adatszolgáltatások a nap végi állapotot tükrözzék, figyelembe véve az adott napon bekövetkezett összes vonatkozó

módosítást. Következésképpen figyelembe véve a T+1 adatszolgáltatási határidőt, a szerződő fél felé nem elvárás, hogy a biztosíték, az értékelés, a letét vagy az újrafelhasználás tekintetében helyesítő adatszolgáltatást végezzen a folyó napra vagy az előző munkanapra vonatkozóan. Éppen ellenkezőleg, a biztosíték, az értékelés, a letét vagy az újrafelhasználás helyesbítéseit a múltbeli adatok tekintetében csak abban az esetben kell benyújtani, ha a szolgáltatott információkban az adatszolgáltatási határidő után hibát találtak.

76. Az ügylet hiteloldalával kapcsolatos információk esetében minden módosításról önmagában és a hiteladatok helyesbítéseitől elkülönítve kell adatot szolgáltatni. Az ugyanazon a napon bekövetkező különböző módosítások egyetlen adatszolgáltatás keretében jelenthetők be, amennyiben ez az adatszolgáltatás pontosan tükrözi az összes változást.
77. Az egyes adatszolgáltatás-típusok tekintetében kötelezően előírt konkrét mezőket az ellenőrzési szabályok határozzák meg.
78. Bizonyos olyan mezők vonatkozásában, amelyeket nem szabad módosítani (pl. Végrehajtási időbélyeg), a kereskedési adattárhoz nem várják el annak ellenőrzését, hogy nem módosul-e e mezők tartalma, ha azokat „MODI” intézkedéstípusként jelentik, kivéve, ha az adott mezőre vonatkozó ellenőrzési szabályok másként rendelkeznek.

4.8.3 Az intézkedéstípusok sorrendje a különböző típusú üzenetek esetében

79. A 2., a 3. és a 4. táblázat információkat nyújt az intézkedéstípusok sorozatának azon különféle kombinációiról, amelyeket nem tiltnak az ellenőrzési szabályok². A 2. táblázatban bemutatott információk ügylet- és pozíciószintű³ adatszolgáltatásra vonatkoznak, míg a 3 és 4. táblázat kifejezetten a központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekhez kapcsolódó letétről és az újrafelhasználásról történő adatszolgáltatásra vonatkoznak.

| | | Following Steps | | | | | | | |
|---------------|-------|-----------------|-------|-------------|--------------|-----------|------------|------------|--------------------|
| | | New | Error | Termination | Modification | Valuation | Collateral | Correction | Position Component |
| Previous Step | New | | x | x | x | x | x | x | |
| | Error | | | | | | | | |

² Az ellenőrzési szabályok meghatározásában bekövetkező jövőbeli változások befolyásolhatják a táblázat tartalmát.

³ A pozíció-összetevő nem vonatkozik a pozíciószintű adatszolgáltatásra.

2. táblázat – Szerződő felekre vonatkozó adatok, hitel- és biztosítéki adatok

| | | Following Steps | | | | | | | |
|--|--------------------|-----------------|-------|-------------|--------------|-----------|------------|------------|--------------------|
| | | New | Error | Termination | Modification | Valuation | Collateral | Correction | Position Component |
| | Termination | | x | | x | x | x | x | |
| | Modification | | x | x | x | x | x | x | |
| | Valuation | | x | x | x | x | x | x | |
| | Collateral | | x | x | x | x | x | x | |
| | Correction | | x | x | x | x | x | x | |
| | Position Component | | x | | | | | x | |

3. táblázat – Letét aktualizálása

| | | Following step | | | |
|---------------|---------------|----------------|-------|---------------|------------|
| | | New | Error | Margin update | Correction |
| Previous step | New | | x | x | x |
| | Error | | | | |
| | Margin update | | x | x | x |
| | Correction | | x | x | x |

4. táblázat – Újrafelhasználásra, pénzeszköz-újrabefektetésre és finanszírozási forrásokra vonatkozó adatok

| | | Following step | | | |
|---------------|--------------|----------------|-------|--------------|------------|
| | | New | Error | Reuse update | Correction |
| Previous step | New | | x | x | x |
| | Error | | | | |
| | Reuse update | | x | x | x |
| | Correction | | x | x | x |

80. A 2., 3. és 4. táblázat alkalmazásakor fontos tisztában lenni azzal, hogy azok olyan intézkedéstípusokat képviselnek, amelyekről egy másik intézkedéstípus bevitelét követően bármikor adatot lehet szolgáltatni, nem csak a megengedett, közvetlenül soron következő lépésnél. Például a „Pozíció-összetevő” intézkedéstípusú adatszolgáltatás elküldése után csak „Helyesbítés” vagy „Hiba” küldhető. „Helyesbítés” elküldése után azonban bármilyen más típusú adatszolgáltatás megengedett. Kérdésként merülhet fel, hogy ha valamely szervezet „Pozíció-összetevő” intézkedéstípussal küldött adatszolgáltatást, majd ezután „Helyesbítést” küldött ugyanahhoz az egyedi ügyletazonosítóhoz, ez a szervezet folytathatja-e adatszolgáltatások küldését más intézkedéstípusokkal. A válasz nem. A „Helyesbítés” intézkedéstípus nem törli/nem szünteti meg azon logikai korlátozások alkalmazását, amelyeket az adatszolgáltatás „Pozíció-összetevő” intézkedéstípusként történő korábbi benyújtása váltott ki. Ezért az adott szervezet továbbra is csak „Hibát” vagy más „Helyesbítést” nyújthat be ugyanahhoz az intézkedéstípushoz. Hasonlóképpen, az előzőleg lezárt értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó helyesbítés benyújtása után az értékpapír-finanszírozási ügyletet nem kell újra lezárni „Lezárás/idő előtti lezárás” intézkedéstípusként (mivel a „Helyesbítés” nem befolyásolja az ügylet már nem lezáratlan státuszát).
81. A „Hiba” és a „Helyesbítés” az egyedüli elfogadható intézkedéstípus a „Pozíció-összetevő” intézkedéstípussal történő adatszolgáltatást követően. Ennek az az oka, hogy miután az értékpapír-finanszírozási ügylet bekerült a pozícióba, minden azt követő adatszolgáltatást (beleértve a biztosítékok aktualizálását is) pozíció szinten kell végezni. Ezért az adatszolgáltatásokat más egyedi ügyletazonosítóval (a pozícióéval) kell benyújtani, és ezen pozíció adatszolgáltatásainak helyes sorrendjét is ellenőrizni kell.

82. Az értékpapír-finanszírozási ügylettel kapcsolatos adatszolgáltatásokat a végrehajtás-technikai standardokban meghatározott követelményekkel összhangban az események bekövetkezésének megfelelő időrendi sorrendben kell elküldeni. Elismerjük azonban, hogy abban az esetben, ha a szervezet nem időben szolgáltat adatokat, vagy ha tudomására jutott, hogy korábban nem megfelelő információkat adtak meg, a szervezetnek múltbeli eseménydátumokkal kell elküldenie az adatszolgáltatásokat, megszakítva ezzel az időrendi sorrendet.
83. A kereskedési adattáraknak azonban csak annyiban kell felülvizsgálniuk az „Esemény dátumát”, hogy megbizonyosodjanak arról, hogy az nem jövőbeli dátum (ezt kifejezetten rögzítik az ellenőrzési szabályok), valamint
- „múltbeli” eseménydátumok esetében (azaz amelyek korábbiak, mint az adatszolgáltatási dátum -1) ezek az események nem változtatják meg az ügyleteke lejáratuk vagy lezárásuk után, azaz a bejelentett eseménydátum korábbi, mint a lejárat dátum és – ha ki van töltve, akkor – a lezárási dátum (ez szintén tükröződik az ellenőrzési szabályokban). A kereskedési adattáraknak azt is ellenőrizniük kell, hogy a múltbeli eseménydátummal küldött módosítások nem változtatják-e meg a korábban jelentett lejárat dátumot. Ezenkívül a kereskedési adattárak nem alkalmazhatják a jelentett változást sem a jelenlegi kereskedési állapotjelentéshez (ha az ügylet továbbra is lezáratlan), sem az eseményről történő adatszolgáltatás napjára vonatkozó múltbeli kereskedési állapotjelentéshez.
 - az adatszolgáltatási dátummal vagy az adatszolgáltatási dátumot megelőző nappal megegyező eseménydátumok esetén a kereskedési adattáraknak a benyújtások sorrendje alapján kell a változásokat alkalmaznia a kereskedési állapotjelentéshez.
84. A kereskedési adattáraknak – az esemény dátumától függetlenül – minden elfogadott kereskedési állapotjelentést a hatóságok rendelkezésére kell bocsátaniuk.
85. A kereskedési adattáraknak az „Esemény dátuma” mező tartalmától függetlenül a beküldésük sorrendje alapján ellenőrizniük kell az adatszolgáltatások helyes sorrendjét.
86. Tekintettel arra, hogy a lejárt vagy lezárt ügyletekkel kapcsolatos bizonyos múltbeli eseményekről adatot lehet szolgáltatni, megengedett „Módosítás”, „Értékelés aktualizálása” vagy „Biztosíték aktualizálása” küldése a „Lezárás/idő előtti lezárás” után (mindaddig, amíg az esemény dátuma megelőzi a lejárat/lezárás dátumát), ami a 2. táblázat adataiban is tükröződik.
87. Meg kell jegyezni, hogy a lezárási esemény utáni biztosítékhelyettesítésekről való adatszolgáltatás nem elvárás (kivéve, ha a lezárást visszavonják). Ezért a lezárásról nem kell adatot szolgáltatni a lezárás hatálybalépése előtt (a lezárásra vonatkozó adatszolgáltatással kapcsolatos további részletekért lásd a 4.9.5. szakaszt).
88. Abban az esetben, ha valamely kereskedési adattár több korábban benyújtott adatszolgáltatást elutasított, a szerződő félnek a lehető leghamarabb helyesbíteni kell és ismét be kell küldenie azokat, fenntartva az események időbeli sorrendjét. Abban az esetben, ha ezek a korábbi adatszolgáltatások olyan eseményekre vonatkoznak, amelyek az adatszolgáltatási napon vagy az azt megelőző napon történtek, és ezért azokat a kereskedési adattár figyelembe veszi kereskedési állapotjelentés nyújtása céljából (a fenti 83. bekezdéssel összhangban), a szerződő félnek esetleg újra be kell nyújtania az utolsó

adatszolgáltatás(oka)t annak érdekében, hogy az ügylet nyilvántartása a legfrissebb információkat tartalmazza.

89. A „Hiba” intézkedéstípust illetően fontos megjegyezni, hogy az adatszolgáltatás beküldését követően azt nem lehet visszavonni vagy más módon „visszacsinálni”. Ezért ha a két szerződő fél valamelyike tévesen küld adatszolgáltatást ilyen intézkedéstípusként, akkor a szerződő feleknek a következő lépéseket kell megtenniük a helyes adatszolgáltatás folytatása érdekében:
- A másik szerződő félnek szintén be kell küldenie egy „Hiba” intézkedéstípusú adatszolgáltatást ugyanarra az egyedi ügyletazonosítóra. Ezt az egyedi ügyletazonosítót nem lehet újra használni.
 - Mindkét szerződő félnek meg kell állapodnia ezen ügylet új egyedi ügyletazonosítójáról, azt „Új” intézkedéstípusként, az elfogadott új egyedi ügyletazonosítóval kell jelenteniük, és ezen egyedi ügyletazonosító használatával folytatniuk kell az esetleges későbbi életciklus-eseményekről történő adatszolgáltatást.
90. Az egyetlen kivétel, amikor a „Hiba” intézkedéstípus benyújtása nem követeli meg a másik szerződő fél részéről az ügylet visszavonását, egy olyan lehetséges forgatókönyv, amikor az egyik szerződő fél tévesen jelenti be az ügyletet két különböző kereskedési adattárnak, és csak az egyik, a felesleges benyújtást szeretné törölni. Ebben az esetben a szerződő félnek egy „Hiba” intézkedéstípusú adatszolgáltatást kell küldenie az egyik kereskedési adattárnak, míg ugyanaz az ügylet nyitva marad a másik kereskedési adattárban, és mindkét szerződő fél ugyanazon egyedi ügyletazonosítóval folytathatja a adatszolgáltatást.
91. Szintén meg kell jegyezni, hogy ez a korlátozás nem vonatkozik a letétekről és az újrafelhasználásról való adatszolgáltatásra. Például a szerződő fél tévesen adatot szolgáltat az újrafelhasználásról (amikor valójában nem történt újrafelhasználás), ebben az esetben újrafelhasználási adatszolgáltatást kell benyújtania „Hiba” intézkedéstípusként. Ez azonban nem akadályozhatja meg a szerződő felet abban, hogy szükség esetén egy későbbi szakaszban újrafelhasználásról szolgáltatson adatot.

4.9 Az értékpapír-finanszírozási ügylet megkötéséről, módosításáról és lezárásáról időben történő adatszolgáltatás

4.9.1 Értékpapír-finanszírozási ügylet megkötése

92. Ha egy megkötött értékpapír-finanszírozási ügyletet később lezárnak (ideértve az elszámolás megíjúsulása miatti lezárást is), akkor a szerződő feleknek – miután arról „Új” intézkedéstípusként szolgáltatnak adatot – arról a „Lezárás/ idő előtti lezárás” intézkedéstípusként kell adatot szolgáltatniuk. Ha az eredeti értékpapír-finanszírozási ügyletről „Pozíció-összetevő” intézkedéstípusként szolgáltatnak adatot, és azt később lezárják, a szerződő felek nem szolgáltathatnak adatot „Lezárás/idő előtti lezárás” intézkedéstípusként az eredeti értékpapír-finanszírozási ügyletre nézve, hanem a szerződő feleknek „Módosítás” intézkedéstípusként kell adatot szolgáltatniuk arra a

pozícióra nézve, amelyben az eredeti értékpapír-finanszírozási ügylet szerepelt, annak érdekében, hogy eltávolítsák ezt az értékpapír-finanszírozási ügyletet a pozícióból.

93. A „Hiba” intézkedéstípust csak azon ügyletek törlésére lehet használni, amelyek soha nem jöttek létre, vagy amelyek nem tartoznak az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatási kötelezettség hatálya alá. Abban a konkrét esetben, amikor a szerződő felek úgy állapodnak meg, hogy a központi szerződő félnél történő regisztrációtól függő ügyletet kötnek, és a központi szerződő fél elutasítja ezt a ügyletet, akkor a szerződő feleknek „Hiba” intézkedéstípusként kell lezárniuk az értékpapír-finanszírozási ügyletet, mivel az ügylet létrejöttének feltétele nem teljesült, ezért az ügylet soha nem is jött létre.
94. Meg kell jegyezni továbbá, hogy a kiegyenlítés olyan átmeneti meghiúsulásáról, amely nem eredményezi az értékpapír-finanszírozási ügylet lezárását, nem kell adatot szolgáltatni.
95. Az értékpapírügyletkehez kapcsolódó hitelezés konkrét esetében az értékpapír-finanszírozási ügylet megkötéséről akkor kell adatot szolgáltatni, amikor először áll fenn rövid pozíció piaci érték vagy nettó készpénzes tartozik egyenleg (az ügyfél szempontjából), és a végrehajtási időbélyeget ennek megfelelően kell kitölteni.

4.9.2 Értékpapír-finanszírozási ügylet módosítása és helyesbítése

96. Egy értékpapír-finanszírozási ügylet módosítása a következő intézkedéstípusokról való adatszolgáltatást foglalja magában: „Módosítás” és „Helyesbítés”. Az adatszolgáltatás időbeli ütemezése megegyezik az ügylet megkötésének lefolyásával, vagyis az attól az időponttól kezdve képezi adatszolgáltatás tárgyát, amikor egy módosítás hatályba lép. Bizonyos esetben, pl. az értékpapír-kölcsönzési vagy értékpapír-kölcsönvételi ügylet kölcsön oldalán bekövetkező változásoknál ez alatt a tervezett kiegyenlítési dátumot kell érteni.
97. A szerződő feleknek csak a bekövetkezett módosításokat kell jelenteniük, azaz nem szolgáltatathatnak adatot olyan módosításokról, amelyekben már megállapodtak, de amelyek még csak a jövőben lépnek hatályba. Például, ha a szerződő felek megállapodnak abban, hogy egy repoügyletet újraértékelnek egy jövőbeli napon, akkor az újraértékelésről csak a megállapodás szerinti időpont (az újraértékelés tényleges időpontja) bekövetkezésekor kell adatot szolgáltatni.
98. Az ügylet megkötéséről való adatszolgáltatáshoz hasonlóan az kiegyenlítés átmeneti meghiúsulásáról sem kell adatot szolgáltatni önmagában, kivéve, ha az az ügylet módosítását eredményezi, amiről ennek megfelelően „Módosítás” intézkedéstípusként kell majd adatot szolgáltatni. Például, ha módosításként szolgáltatott adatot az értékpapír-finanszírozási ügylet részleges visszatérítéséről, majd ezt követően az ügyletet az elszámolás meghiúsulása miatt visszavonják, a szerződő feleknek ezen értékpapír-finanszírozási ügylet újabb módosításáról kell adatot szolgáltatniuk annak érdekében, hogy visszafordítsák a részleges visszatérítésből eredő változásokat.
99. Egy értékpapír-finanszírozási ügylet visszamenőleges módosítása esetén (pl. amikor az értékpapír-finanszírozási ügyletben részt vevő szerződő felek kétoldalúan megállapodnak abban, hogy az ügyletet múltbeli hatályossági dátummal újraértékelik), a szerződő

feleknek nem kell újra benyújtaniuk a visszamenőleges módosítást követő összes tevékenységről szóló adatszolgáltatásokat. Meg kell jegyezni, hogy a visszamenőleges módosítást tartalmazó adatszolgáltatást a helyes múltbeli esemény dátummal kell jelenteni (tükrözve a módosítás hatálybalépésének időpontját). Ebben az esetben a kereskedési adattárak nem alkalmazhatják a módosított adatokat a kereskedési állapotjelentéshez⁴.

100. Ami a helyesbítéseket illeti, ezekről azonnal adatot kell szolgáltatni, amint a helytelenül jelentett adatokat azonosítják. Nem szükséges helyesbítő adatszolgáltatást küldeni, ha az értékpapír-finanszírozási ügylet módosítása után a szerződő fél csak a saját belső rendszereibe vitt be téves információkat – ilyen esetekben a vállalkozásnak csak a végleges, helyes adatokat tartalmazó módosító adatszolgáltatást kell beküldenie.

4.9.3 Biztosítékok aktualizálása

101. A biztosíték aktualizálásáról a biztosíték felhasználásának napja, azaz a kiegyenlítés várható napja tekintetében kell adatot szolgáltatni. Azonban előfordulhat, hogy a szerződő felek ugyan megállapodnak egyes aktualizálásokról, de a szerződő feleknek vagy harmadik feleknek, például a központi szerződő feleknek vagy a központi értéktáraknak betudható okok miatt ezeket esetleg nem véglegesítik. Ez azt jelentené, hogy egy adott biztosíték frissítéséről szóló adatszolgáltatást újra be kell nyújtani a helyes végleges adatokkal. Nem kell adatot szolgáltatni a kiegyenlítés átmeneti megghiúsulásairól, ami nincs hatással a megállapodott biztosíték nyújtására.
102. Más esetekben a szervezetek már megállapodtak ugyan a biztosíték bizonyos módosításairól, de ezeket még nem hajtották végre. A szerződő feleknek csak a biztosíték tényleges aktualizálásáról kell adatot szolgáltatniuk, vagyis nem szolgáltathatnak adatot a biztosítékról a jövőben várható kiegyenlítési dátummal.
103. A biztosíték aktualizálása napi pillanatkép jellegű adatszolgáltatásnak minősül, amelynek a biztosíték adott nap végén fennálló állapotát kell tükröznie. A biztosíték napközbeni változásairól nem kell adatot szolgáltatni. Olyan napközbeni ügyletek konkrét esetében, amelyeknél a biztosítékot csak napközben nyújtják, és a nap végén annak értéke nullára esik, a szerződő feleknek nulla értékű biztosítékról kell adatot szolgáltatniuk.
104. A pozícióba belefoglalt és a „Pozíció-összetevő” intézkedéstípusként jelentett, központi szerződő fél által elszámolt helyszíni ügyletek esetében a biztosíték aktualizálásait az eredeti ügyletek helyett arra a pozícióra kell elküldeni, amelybe ezeket az ügyleteket belefoglalták.
105. Végül meg kell jegyezni, hogy a biztosíték utolsó aktualizálását arra az utolsó napra nézve kell benyújtani, amelyen a megfelelő értékpapír-finanszírozási ügyletek még lezáratlanok, a benyújtási határidő pedig a következő nap vége. Miután „ldő előtti lezárás” intézkedéstípusként adatszolgáltatást küldött be az értékpapír-finanszírozási ügylet(ek)re nézve, vagy miután határidős értékpapír-finanszírozási ügylet(ek) esetén a lejárat dátuma bekövetkezett, a biztosíték aktualizálásait nem kell benyújtani az adott értékpapír-finanszírozási ügyletre nézve (kivéve a hiányzó, elkésztett adatszolgáltatásokat).

⁴ Az esemény dátumnak az adatszolgáltatások kereskedési adattárak általi kezelésére gyakorolt hatásáról a 4.8.3. szakaszban talál további információkat.

106. Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelezés konkrét esetében a biztosíték aktualizálását csak akkor kell küldeni, ha rövid pozíció piaci érték vagy nettó tartozik egyenleg áll fenn (az ügyfél szempontjából). Azokban az esetekben, amikor az ügyfél még nem hívta le az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelt, a szerződő felek nem szolgáltathatnak adatot sem értékpapír-finanszírozási ügyletről, sem az ahhoz tartozó biztosítékról. Előfordulhatnak olyan helyzetek is, amikor az ügyfél lehívta az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelt (ezért adatot szolgáltatott az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelügyletről és a megfelelő biztosítékról), majd ezt követően az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel értéke nulla lesz. Ebben az esetben, ha a szerződő felek nem döntenek úgy, hogy lezárják az értékpapír-finanszírozási ügyletet, akkor „nullás” adatszolgáltatást kell benyújtaniuk a biztosítékról arra az első napra nézve, amelyen az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel értéke nulla. Amint az ügyfél újra felhasználja az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelt, a biztosíték tényleges értékéről adatot kell szolgáltatni ezen értékpapír-finanszírozási ügyletre nézve.

4.9.4 Az értékelés, a letét és az újrafelhasználás aktualizálása

107. Az értékelés aktualizálása esetén a szerződő feleknek napi értékeléseket kell küldeniük az értékelés napját követő munkanap végéig, és ezt a dátumot kell beírniuk az „Esemény dátuma” mezőbe.
108. A letét aktualizálásáról akkor kell adatot szolgáltatni, amikor azok felhasználhatóvá válnak, azaz a kiegyenlítés várható napján, a kiegyenlítés átmeneti megghiúsulásainak figyelembevétele nélkül.
109. A központi szerződő félnek az elszámolt ügyletek portfóliója előtt előre fizetett letétek esetében ezekről a letétekről a kapcsolódó portfólióban szereplő, elsőként alkalmazandó értékpapír-finanszírozási ügylet T+1. napján kell adatot szolgáltatni (a portfólió kódjával összekapcsolva), nem pedig a benyújtásának napját követő napon.
110. Az újrafelhasználásról való adatszolgáltatás tekintetében ezt a kiegyenlítés határozza meg, vagyis a szerződő feleknek csak egy adott nap végén kiegyenlített újrafelhasznált biztosítékok értékéről kell adatot szolgáltatniuk. Ezt az kiegyenlítési dátumot kell az esemény dátumaként feltüntetni az újrafelhasználási adatszolgáltatásokban, amelyeket a következő nap végéig kell benyújtani (azaz az elszámolás dátuma + 1). Az újrafelhasználási adatszolgáltatások nap végi, pillanatkép jellegű jelentések, ami azt jelenti, hogy a nap végén az újrafelhasznált biztosítékokat kell tartalmazniuk, nem pedig az előzőleg jelentett értékekhez képest történt változást („delta-jelentés”).

4.9.5 Értékpapír-finanszírozási ügylet lezárása

111. A szerződő felek nem küldhetnek adatszolgáltatást „Lezárás/idő előtti lezárás” intézkedéstípusként, ha a határozott lejáratú értékpapír-finanszírozási ügylet eléri a lejárat napját, és ezért már nem tekinthető lezáratlannak.
112. Ha a szerződő felek megállapodnak abban, hogy a lejárat napja előtt lezárnak egy határozott lejáratú értékpapír-finanszírozási ügyletet, vagy lezárnak egy nyitott lejáratú értékpapír-finanszírozási ügyletet, akkor a következők egyikét kell tenniük:

- a. adatszolgáltatást nyújtanak be „Lezárás/idő előtti lezárás” intézkedéstípusként, ha a lezárás várható kiegyenlítése ugyanazon a napon történik, mint a lezárásról szóló értesítés, vagy
 - b. adatszolgáltatást nyújtanak be „Módosítás” intézkedéstípusként, ha a lezárás várható kiegyenlítése a következő napon vagy később történik. Ebben az esetben a szerződő feleknek a lejárat dátumot ennek megfelelően módosítaniuk kell.
113. Tekintettel arra, hogy az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelethez kapcsolódó szabályozástechnikai standardokban/végrehajtás-technikai standardokban előírányzott adatszolgáltatási logika alapján (és összhangban az EMIR szerinti jelenlegi adatszolgáltatási logikával) nincs lehetőség az ügylet „újból megnyitására” annak lezárása után, a szerződő felek nem jelenthetik a lezárást, ha az nem az elszámolás meghiúsulása miatt történik.
114. A gyakorlatban, ha a szerződő felek az idő előtti lezárás megállapodás szerinti dátumát követő napon tudomást szereznek arról, hogy a lezárás teljesítésére nem került sor a kiegyenlítés várható napján, akkor a lezárás teljesítéséig nem küldhetnek „Lezárás/idő előtti lezárás” intézkedéstípusként adatszolgáltatást. Ha a lezárást a kiegyenlítés meghiúsulása miatt visszavonják, a szerződő felek nem küldhetik el az adatszolgáltatást „Lezárás/korai lezárás” intézkedéstípusként, mivel az értékpapír-finanszírozási ügylet továbbra is lezáratlannak minősül.
115. Hasonlóképpen, olyan értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében, amelyek lejárat napjukhoz(vagy az eredeti szerződésben megállapodott lejárat naphoz (2.14. mező), vagy egy előre megállapodott idő előtti lezárásról való adatszolgáltatás végett módosított lejárat naphoz) közelednek, ha a lejárat napját követő napon a szerződő felek tudomást szereznek arról, hogy az értékpapír-finanszírozási ügylet visszairányú lábának kiegyenlítése nem történt meg, módosító adatszolgáltatást kell küldeniük, amelyben a lejárat dátumot a következő napra vagy más jövőbeli napra módosítják, amelyen várhatóan sor kerül a kiegyenlítésre. Meg kell jegyezni, hogy a lejárat dátum ilyen módosítása csak a lejárat dátumot követő napig lehetséges, mivel ettől a naptól kezdve az értékpapír-finanszírozási ügylet már nem minősül lezáratlannak, és azt nem lehet „újból megnyitni”. Amikor a visszairányú kiegyenlítés sikeresen megtörténik, a szerződő felek nem küldhetnek további adatszolgáltatásokat, mivel a rendszer a lejárat dátumot követő naptól kezdve lezártként kezeli az értékpapír-finanszírozási ügyletet.

4.9.6 A adatszolgáltatási határidők adatszolgáltatás-típusonkénti és intézkedéstípusonkénti áttekintése

116. Az 5. táblázat minden egyes adatszolgáltatás-típus és intézkedéstípus esetében meghatározza, hogy mit kell az „Esemény dátumaként” jelenteni. Az esemény dátuma – lényegénél fogva – azt is jelzi, hogy mi váltja ki az adatszolgáltatási kötelezettséget, pl. biztosíték aktualizálása esetén a kiegyenlítés várható dátuma, értékelés aktualizálása esetén pedig az értékelés dátuma. A tényleges adatszolgáltatásokat az esemény dátumát követő munkanap végéig kell benyújtani.

5. táblázat – Esemény dátuma

| Table | Action type | Esemény dátuma |
|-------|-------------|---|
| 1&2 | NEWT | A szerződés megkötésének dátuma („ügyletkötés napja”) |
| 1&2 | MODI | A módosítás hatálybalépésének dátuma vagy adott esetben a kiegyenlítés várható dátuma |
| 1&2 | CORR | Az a dátum, amelytől kezdve a helyesbítés alkalmazandó (általában az a dátum, amelyre vonatkozóan a korábbi helytelen adatokat szolgáltatották) |
| 1&2 | ETRM | A lezárás várható teljesítési dátuma |
| 1&2 | EROR | NA |
| 1&2 | COLU | A kiegyenlítés várható dátuma |
| 1&2 | VALU | Az értékelés napja |
| 3 | NEWT | A kiegyenlítés várható dátuma |
| 3 | MARU | A kiegyenlítés várható dátuma |
| 3 | CORR | Az a dátum, amelytől kezdve a helyesbítés alkalmazandó (általában az a dátum, amelyre vonatkozóan a korábbi helytelen adatokat szolgáltatották) |
| 3 | EROR | NA |
| 4 | NEWT | A kiegyenlítés tényleges dátuma |
| 4 | REUU | A kiegyenlítés tényleges dátuma |
| 4 | CORR | Az a dátum, amelytől kezdve a helyesbítés alkalmazandó (általában az a dátum, amelyre vonatkozóan a korábbi helytelen adatokat szolgáltatották) |
| 4 | EROR | NA |

4.10 Az üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

117. A 6. táblázat megmutatja, hogy az értékpapír-finanszírozási ügylet életciklusa során bekövetkező üzleti eseményekhez az adatszolgáltatásról szóló technikai standardokban meghatározott mely intézkedéstípusok kapcsolódnak.
118. Ha a szerződő felek az értékpapír-finanszírozási ügylet idő előtti lezárásáról és felcsereléséről állapotodnak meg, erről megfelelően adatot kell szolgáltatni. Ilyen esetekben a szerződő feleknek először le kell zárniuk az eredeti értékpapír-finanszírozási ügyletet (vagy a „Lezárás/idő előtti lezárás”, vagy a „Módosítás” intézkedéstípus módosított lejárat dátummal történő elküldésével), majd be kell nyújtaniuk az új ügyletre vonatkozó adatszolgáltatást („Új” intézkedéstípusként).
119. Hasonlóképpen, a táblázat egyszerűsítése érdekében minden olyan esemény, amely egy értékpapír-finanszírozási ügylet lezárását eredményezi, a „Lezárás/idő előtti lezárás” intézkedéstípushoz tartozik, kivéve a 44. eseményt, amely kifejezetten a lezárásokról való adatszolgáltatásra vonatkozik. Elismerjük azonban, hogy ha egy ügylet lezárásáról egy másik jövőbeli dátummal állapotodnak meg, akkor arról általában a lejárat dátum módosításaként kell adatot szolgáltatni („Módosítás” intézkedéstípusként), míg az ugyanazon a napon történő lezárásról a „Lezárás/idő előtti lezárás” intézkedéstípusként kell adatot szolgáltatni.

120. Az adatszolgáltatásról szóló technikai standardokban nem szerepelhet további intézkedéstípus, ezért a szerződő feleknek a technikai standardokban szereplőket kell használniuk, amikor értékpapír-finanszírozási ügyletekről és az azokkal kapcsolatos releváns üzleti eseményekről szolgáltatnak adatot.

121. A különféle típusú értékpapír-finanszírozási ügyletek üzleti életciklusának eseményeiről a következő intézkedéstípusok (2.98. mező) és releváns szintek (2.99. mező) használatával kell adatot szolgáltatni⁵.

| 6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése | | | | | | |
|---|--|-------------|-------------------------------------|----------------|-------------|--|
| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
| 1 | Backloading | All | Table 1 and Table 2 | NEW T | TCTN / PSTN | |
| 2 | Conclusion | All | Table 1 and Table 2 | NEW T or POS C | TCTN / PSTN | Ez magában foglalja az ügynök által az ügyfeleknek való allokáció céljából kötött tömbösített/egyesített/tömeges ügyleteket is. Ez minden olyan, adatszolgáltatás tárgyát képező ügyletet is magában foglal, amelyet kiegyenlítés céljából kötnek ((nemzetközi) központi értéktár általi automatikus fedezetnyújtás, egyéb hitelkeretek, értékpapírok napon belüli automatikus kölcsönbe vétele a (nemzetközi) központi értéktártól). A nyitó láb kiegyenlítéséről – ideértve az olyan késedelmes kiegyenlítést is, amely nem eredményezi az értékpapír-finanszírozási ügylet lezárását vagy egyéb változását –, nem kell külön adatot szolgáltatni. Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel esetében a megkötésről akkor kell adatot szolgáltatni, amikor a hitelnyújtásra első alkalommal sor kerül. |
| 3 | Roll-over into new identical transaction | REPO | Table 1 and Table 2 | NEW T | TCTN | |
| 4 | Extension | REPO, SLB | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | Ebbe beletartozik például a meghosszabbítható repoügylet meghosszabbítása, a határozott lejáratú repoügylet visszavásárlási dátumának megváltoztatására irányuló eseti megállapodás, vagy a meghíúsuláskezelési folyamat részeként a visszavásárlási dátum elhalasztására irányuló megállapodás. |

⁵ Az üzleti események felsorolása nem kimerítő jellegű.

⁶ A hivatkozások az adatszolgáltatásról szóló szabályozástechnikai standardok és végrehajtás-technikai standardok táblázataira vonatkoznak.

6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
|-------------|---|---------------|-------------------------------------|---------------|-------------|---|
| 5 | Automatic change of purchase and repurchase dates of an evergreen SFT at the end of each business day until termination or maturity | REPO, SLB | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | |
| 6 | Cancellation of disputed transaction (after external reporting) | All | Table 1 and Table 2 | ERO R | - | |
| 7 | New allocation of the SFTs | All | Table 1 and Table 2 | NEW T | TCTN | Például a mögöttes megbízók személyének ügynök általi felfedése másik fél előtt egy „egyesített” ügynöki repoügylet során. |
| 8 | Full reallocation with a new UTI | All | Table 1 and Table 2 | ETR M + NEW T | TCTN | Ide tartozik az az eset is, amikor az újraelosztásra az eredeti ügylet nyitó lábának elszámolása előtt kerül sor. |
| 9 | Full reallocation to an existing UTI | All | Table 1 and Table 2 | ETR M + MOD I | TCTN | Ide tartozik az az eset is, amikor az újraelosztásra az eredeti ügylet nyitó lábának elszámolása előtt kerül sor. |
| 10 | Partial reallocation to a new UTI | All | Table 1 and Table 2 | MOD I + NEW T | TCTN | Ide tartozik az az eset is, amikor az újraelosztásra az eredeti ügylet nyitó lábának elszámolása előtt kerül sor. |
| 11 | Partial reallocation to an existing UTI | All | Table 1 and Table 2 | MOD I + MOD I | TCTN | Ide tartozik az az eset is, amikor az újraelosztásra az eredeti ügylet nyitó lábának elszámolása előtt kerül sor. |
| 12 | Increase or reduce size of a repo by modifying the terms of the contract (same UTI, no settlement instructions issued) | REPO | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | |
| 13 | Agreement to accept the partial delivery of the collateral as final implemented by a change in contractual terms | REPO | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | |
| 14 | Partial termination | REPO, BSB, ML | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN / PSTN | |
| 15 | Partial return | All | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN / PSTN | A részleges visszatérítés kiegyenlítéséről – ideértve az olyan késedelmes kiegyenlítést is, amely nem eredményezi a részleges visszatérítés megszüntetését –, nem kell külön adatot szolgáltatni. |

6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
|-------------|---|----------------|-------------------------------------|-------------|-------------|---|
| 16 | Cancellation or failure of the partial return | SBL | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN / PSTN | A késedelmes kiegyenlítéséről, amely nem eredményezi a részleges visszatérítés megszüntetését, nem kell adatot szolgáltatni. |
| 17 | Re-rating (fixed rate, spread or rebate rate) | REPO, BSB, SLB | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | |
| 18 | Agreed cancellation of the re-rate, hence reverting to the previous rate | REPO, BSB, SLB | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | Ha az újraértékelésről nem született megállapodás, de arról tévedésből egyoldalúan adatot szolgáltatottak, akkor az előző érték változásáról a „CORR” jelzéssel kell adatot szolgáltatni. |
| 19 | Change in floating repo rate | REPO | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | |
| 20 | Scheduled change in rate on floating-rate collateral or index on index-linked collateral in a BSB | BSB | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN | Ez az esemény a visszavásárlási ár módosításáról szóló adatszolgáltatást eredményez. |
| 21 | Events impacting the collateral value | REPO, BSB | Table 1 and Table 2 | COL U | - | Például biztosítékból származó jövedelem kifizetése (repoügylet, vétel-eladás ügylet), hozampótló kifizetés (repoügylet, vétel-eladás ügylet), a változó kamatozású biztosítékok kamatlábának tervezett változása vagy az indexhez kötött biztosítékok indexe bármilyen típusú repoügyletben. |
| 22 | Cash mark | SBL | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN / PSTN | |
| 23 | Fee mark | SBL | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN / PSTN | |
| 24 | Valuation of securities on loan | SLB | Table 1 and Table 2 | VAL U | - | |
| 25 | Flat margin loan and/or short market value | ML | Table 1 and Table 2 | MOD I | - | |
| 26 | Change in outstanding margin loan or short market value | ML | Table 1 and Table 2 | MOD I | - | |
| 27 | Change of base currency used for margin loan | ML | Table 1 and Table 2 | MOD I | - | |
| 28 | Additional base currency used for margin loan | ML | Table 1 and Table 2 | NEW T | - | Értékpapírügyletkez kapcsolódó hitelenként csak egy bázispénznem adható meg, ezért a további bázispénznemről új értékpapírügyletkez kapcsolódó hitelenként, új egyedi ügyletazonosítóval kell adatot szolgáltatni. |

6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
|-------------|---|-------------|-------------------------------------|----------------|-------|--|
| 29 | Valuation of securities used as collateral | All | Table 1 and Table 2 | COL U | - | |
| 30 | First allocation of collateral on the day of trade | REPO | Table 1 and Table 2 | NEW T or COL U | TCTN | NEWT intézkedéstípust akkor kell használni, amikor a biztosíték részleteiről az értékpapír-finanszírozási ügylet más részleteivel együtt szolgáltatnak adatot új ügyletre vonatkozó adatszolgáltatás keretében. Ez történhet például akkor, amikor az eladó a biztosítékot egy új általános fedezetű repoügyletbe rendeli hozzá, vagy a három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök a biztosítékot első alkalommal rendeli hozzá az ügyletkötés napján. |
| 31 | First allocation of collateral after the day of trade | REPO | Table 1 and Table 2 | COL U | TCTN | Ez történhet például akkor, amikor az eladó a biztosítékot egy új általános fedezetű repoügyletbe rendeli hozzá, vagy a három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök a biztosítékot első alkalommal rendeli hozzá az ügyletkötés napja után. |
| 32 | Substitution of Collateral | All | Table 1 and Table 2 | COL U | - | Ide tartozik például az értékpapírok készpénzzel történő ideiglenes helyettesítése (általában három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök által) abban az esetben, ha az eladó számláján nincs elfogadható biztosíték, az ideiglenes készpénzbiztosíték értékpapír-biztosítékkal történő helyettesítése, az értékpapírok késedelmes visszaszolgáltatása esetén az általános visszavásárlási keretmegállapodás (GMRA) 6. cikkének h) pontja szerinti, kiegészítő változó letét befizetésére való felhívásra válaszul nyújtott ideiglenes készpénz-fedezet. Ide tartoznak továbbá a vállalati események miatt bekövetkezett, biztosítékkal kapcsolatos változások is. |
| 33 | Change in collateral quality | All | Table 1 and Table 2 | COL U | - | |
| 34 | Change in cash collateral amount or currency | REPO, SLB | Table 1 and Table 2 | COL U | - | |
| 35 | Buy-in where required by regulation (e.g. CSDR) or market | All | Table 1 and Table 2 | COL U | - | |

6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
|-------------|--|----------------|-------------------------------------|--------------|-------------|--|
| | convention (not under GMRA) | | | | | |
| 36 | Cash compensation where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA) | All | Table 1 and Table 2 | COLU | - | |
| 37 | Default of the collateral issuer | All | ALL | COLU or ETRM | TCTN / PSTN | ETRM-ről csak akkor lehet adatot szolgáltatni, ha az értékpapír-finanszírozási ügylet a biztosíték kibocsátójának mulasztása miatt lezárul. Egyébként a biztosíték helyettesítéséről COLU-ként kell adatot szolgáltatni. |
| 38 | Variation margining | REPO, SLB, BSB | Table 1 and Table 2 | COLU | - | Ez egy külön COLU adatszolgáltatás a nettó kitétségről. |
| 39 | Change in haircut or margins | REPO, SLB | Table 1 and Table 2 | COLU | TCTN / PSTN | |
| 40 | Clearing off-venue | All | Table 1 and Table 2 | ETRM + NEWT | TCTN / PSTN | Ide tartoznak az ugyanazon a napon vagy azt követően elszámolt tőzsdén kívüli ügyletek. |
| 41 | Post-trade clearing of a transaction executed on a trading venue | All | Table 1 and Table 2 | ETRM + NEWT | TCTN / PSTN | Ide tartoznak az ügylet napját követően elszámolt, kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek. |
| 42 | Same-day clearing of a transaction executed on a trading venue | All | Table 1 and Table 2 | NEWT | TCTN / PSTN | Ide tartoznak azok az ügyletek is, amelyeket a kereskedési helyszínen végeztek, nyitott ajánlati modell alapján és ugyanazon napi novációval számolták el. |
| 43 | CCP rejects transaction which is conditional upon registration with the CCP | All | Table 1 and Table 2 | EROR | - | |
| 44 | Termination of an open SFT or termination of a term repo (by agreement or unilaterally) | REPO, SLB | Table 1 and Table 2 | MODI or ETRM | TCTN | ETRM-ről kell adatot szolgáltatni az ugyanazon a napon történő lezáráskor, míg MODI-t kell használni egy jövőbeni napon történő lezárásról való adatszolgáltatáshoz (a lejárat dátum módosításával) |
| 45 | Termination of an evergreen or puttable SFT | REPO, SLB | Table 1 and Table 2 | MODI | TCTN | Ez magában foglalja a lezárási lehetőség kizárását is. |
| 46 | Maturity/Expiration | All | Table 1 and Table 2 | no report | - | A lejáró értékpapír-finanszírozási ügylet elszámolásának ideiglenes megíiusulásáról nem szabad külön adatot szolgáltatni |

6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
|-------------|---|-------------|-------------------------------------|--------------------|-------------|--|
| 47 | Full return of a term SLB prior to the maturity date or of an open term SLB | SBL | Table 1 and Table 2 | ETRM | - | A teljes visszatérítés kiegyenlítéséről – ideértve az olyan késedelmes kiegyenlítést is, amely nem eredményezi a teljes visszatérítés megszüntetését –, nem kell külön adatot szolgáltatni. |
| 48 | Cancellation or failure of the full return | SBL | Table 1 and Table 2 | no report or NEW T | TCTN | Teljes visszatérítésről nem kell adatot szolgáltatni, ha azt nem rendezik, ezért ha a teljes visszatérítést törlik, nincs szükség további adatszolgáltatásra. Ha azonban a teljes visszatérítésről ETRM-ként szolgáltatott adatot, és ezt követően a teljes visszatérítést törlik, akkor az ügyletről NEW T intézkedéstípusként, új egyedi ügyletazonosítóval kell adatot szolgáltatni. |
| 49 | Closure of an SFT due to counterparty default | All | Table 1 and Table 2 | ETRM | - | Ide tartozik például a szerződő fél nemteljesítővé minősítése, feltéve, hogy erről a nemteljesítési opcióról megállapodtak a GMRA 10. cikke a) pontjának ii. alpontja szerint. |
| 50 | Termination of transaction under specific GMRA provisions | REPO, BSB | Table 1 and Table 2 | ETRM | - | Ide tartozik: Ügylet lezárása a 2000. évi GMRA 10. cikke g) pontjának rendelkezése vagy a 2011. évi GMRA 10. cikke h) pontjának rendelkezése szerint. A 2000. évi GMRA 10. cikkének h) pontja vagy a 2011. évi GMRA 10. cikkének i) pontja szerinti „Mini lezárás”. A 2000. évi GMRA 4. cikkének i)-k) pontja vagy a 2011. évi GMRA 4. cikkének j)-l) pontja szerinti átárazás vagy kiigazítás. |
| 51 | Terminating the relationship between prime broker and the client | ML | Table 1 and Table 2 | ETRM | - | |
| 52 | Amend trade - bilateral | All | Table 1 and Table 2 | MOD I | TCTN / PSTN | A szerződő felek megállapodnak abban, hogy módosítják az ügylet egyik jellemzőjét. Ez egy általánosan alkalmazható esemény minden olyan módosítás esetében, amely nincs külön felsorolva. |
| 53 | Amend trade - unilateral | All | Table 1 and Table 2 | COR R | TCTN / PSTN | Az egyik szerződő fél helyesbíti az ügylet egyik jellemzőjét. |
| 54 | Amend collateral - bilateral | All | Table 1 and Table 2 | COL U | TCTN / PSTN | A szerződő felek megállapodnak abban, hogy módosítják a biztosíték egyik jellemzőjét. Ez egy általánosan alkalmazható esemény minden olyan |

6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
|-------------|--|-------------|-------------------------------------|-------------|-------------|--|
| | | | | | | módosítás esetében, amely nincs külön felsorolva. |
| 55 | Amend collateral - unilateral | All | Table 1 and Table 2 | COR R | TCTN / PSTN | Az egyik szerződő fél helyesbíti a biztosíték egyik jellemzőjét |
| 56 | Lifecycle event (e.g. change in size or re-rating of open repo) incorrectly reported | All | Table 1 and Table 2 | COR R | TCTN / PSTN | A helytelenül jelentett idő előtti lezárást vagy hibát nem lehet helyesbíteni. Miután ilyen intézkedéstípusként elküldték az adatszolgáltatást, nincs mód az ügylet lezáratlan állapotba való visszaállítására, ezért az ügyletről NEWT intézkedéstípusként, új egyedi ügyletazonosítóval újra adatot kell szolgáltatni. |
| 57 | Transaction not executed or out of scope of SFTR but reported to TR by mistake | All | Table 1 and Table 2 | ERO R | - | |
| 58 | Initial posting of margin to a CCP for cleared SFTs | All | Table 3 | NEW T | - | |
| 59 | Update of the initial margin posted at the CCP | All | Table 3 | MAR U | - | |
| 60 | Posting variation margin to a CCP for cleared SFTs | All | Table 3 | MAR U | - | |
| 61 | Correction of a previous submitted margin report | All | Table 3 | COR R | - | |
| 62 | Cancellation of a wrongly submitted margin report | All | Table 3 | ERO R | - | |
| 63 | First report of reuse of collateral or reinvestment of cash collateral | All | Table 4 | NEW T | - | |
| 64 | Change in the securities reused or update of the estimated reuse or value of reused collateral | All | Table 4 | REU U | - | |
| 65 | Change in cash collateral reinvestment type, amount or currency | SLB | Table 4 | REU U | - | |
| 66 | Correction of a previously submitted collateral reuse report with incorrect data | All | Table 4 | COR R | - | |

6. táblázat – Üzleti események intézkedéstípusokhoz és intézkedési szintekhez való hozzárendelése

| New Event # | Business / Trade Event | Type of SFT | Applicable XML Message ⁶ | Action Type | Level | Megjegyzések/példák |
|-------------|--|-------------|-------------------------------------|-------------|-------|---------------------|
| 67 | Cancellation of a wrongly submitted collateral reuse report (e.g. for an entity not subject to the reporting obligation) | All | Table 4 | ERROR | - | |

4.11 A központi értéktár résztvevőjének azonosítása

122. Azon esetek kivételével, amikor értékpapírügyletbe kapcsolódó hitelről szolgáltatnak adatot, vagy amikor egy ügylet áruhoz kapcsolódik, a szerződő feleknek mindig ki kell tölteniük a „Központi értéktár résztvevője vagy közvetett résztvevője” mezőt. A mező tekintetében akkor is adatot kell szolgáltatni, ha az értékpapír-finanszírozási ügylet kiegyenlítése a központi értéktáron kívül történik. Az ESMA szerint az adatszolgáltatást végző szerződő félnek e mezőt illetően a következő logikát követve kell adatot szolgáltatnia:

- a. meg kell adnia a saját jogalany-azonosítóját, ha az értékpapírokat valamely központi értéktárnál közvetlenül egyenlíti ki, azaz a központi értéktár résztvevője;
- b. meg kell adnia a saját jogalany-azonosítóját, ha az értékpapírokat a két nemzetközi központi értéktár egyikénél egyenlíti ki, még akkor is, ha a nemzetközi központi értéktár nem a kibocsátó központi értéktár, azaz a szerződő fél a nemzetközi központi értéktár résztvevője;
- c. meg kell adnia letétkezelő bankjának jogalany-azonosítóját, függetlenül attól, hogy a letétkezelő alkalmaz-e alletétkezelőt vagy sem. Ide tartoznak azok az esetek is, amikor egy szerződő fél kölcsönnyújtó ügynököt vesz igénybe.

123. A szerződő fél a „Központi értéktár résztvevője” mezőben nem jelentheti azon központi értéktár jogalany-azonosítóját, amelynek közvetlen vagy közvetett résztvevője.

4.12A szerződő fél minőségének meghatározása

4.12.1 Általános eset

124. Repoügyletek vagy vétel-eladás ügyletek esetében a vevő a biztosíték fogadója, az eladó pedig a biztosíték nyújtója.

125. Árukat érintő értékpapír-kölcsönzési vagy értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a kölcsönnyújtó a biztosíték fogadója, a kölcsönvevő pedig a biztosíték nyújtója.

126. Értékpapírügyletbe kapcsolódó hitelek esetében a kölcsönnyújtó a biztosíték fogadója, a kölcsönvevő pedig a biztosíték nyújtója.

4.12.2 A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

127. A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a központi szerződő fél a két szerződő fél közé helyezi magát az értékpapír-finanszírozási ügyletben. Ezért vevő lesz az eladó viszonylatában, kölcsönvevő lesz a kölcsönnyújtó viszonylatában, eladó lesz a vevő viszonylatában és kölcsönnyújtó lesz a kölcsönvevő viszonylatában.

4.12.3 Értékpapírok fedezetlen kölcsönbe adásáról/kölcsönbe vételéről való adatszolgáltatás

128. Értékpapírok fedezetlen kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele esetén az értékpapírokat kölcsönbe adó szerződő félnek a biztosítékfogadóként kell jelentenie magát, az értékpapírokat kölcsönbe vevő szerződő félnek pedig biztosítéknyújtóként kell jelentenie magát az 1.9. mezőben.

4.12.4 A szerződő fél minőségéről való adatszolgáltatás nettó kitétségi alapon nyújtott biztosíték esetén

129. Nettó kitétségi alapon nyújtott biztosíték esetén a szerződő feleknek nem kell adatot szolgáltatniuk a „Szerződő fél minősége” mezőben a változó letétként használt biztosítékkal kapcsolatban. A szerződő feleknek azonban azt követően, hogy meghatározták, hogy ők nettó biztosíték nyújtói vagy nettó biztosíték fogadói-e, az 5.4.7. szakaszban részletezettek szerint adatot kell szolgáltatniuk a változó letéltelnyújtáshoz tartozó biztosítékról.

4.13 Árral és értékkel kapcsolatos mezők

4.13.1 Az értékelések időzítése

130. Az értékpapír-finanszírozási ügylet elszámolásakor a központi szerződő féltől beszerzett, értékelésekkel kapcsolatos információkat kell használni az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatáshoz.

131. Az értékpapírok piaci értékének az egyes munkanapokon az üzletzáráskor fennálló értéknek kell lennie, és arról legkésőbb a T+1. napon adatot kell szolgáltatni, és annak a biztosítékkezelési célokra, pl. a napi változó letét kiszámításához alkalmazott értékelést kell tükröznie.

132. A szerződő feleknek az értékpapír-finanszírozási ügyleteik piaci értékéről az általuk az adott munkanapon kitétségkezelési célokra használt piaci árak és devizaárfolyamok felhasználásával kell adatot szolgáltatniuk. Értékpapír-kölcsönzési ügyletek esetében ez általában azt jelentené, hogy a bármely adott napon üzletzáráskor fennálló piaci értéként jelentett piaci értékek az értékpapírok előző munkanapon érvényes záróárai lennének, amelyeket legkésőbb a T+1. napon kell jelenteni.

133. Ha két különböző napra vonatkozó értékeléseket adnak meg, akkor a szerződő feleknek minden egyes különböző napra ennek megfelelően kell kitölteniük a 2.3. „Esemény dátuma” mezőt.

4.13.2 Az értékelésekhez használt számítási módszerek

134. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatás során a szerződő feleknek azt az értéket kell használniuk, amelyet fedezetkezelési és kitettségekkezelési célokra használnak.
135. Ha nem áll rendelkezésre piaci érték, az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet nem ír elő konkrét módszert ezen értékek kiszámítására. Mindazonáltal a 2.57. és a 2.88. mezőben megadott adatok összeegyeztethető adatok, ezért a szerződő feleknek meg kell állapodniuk és olyan értékeket kell jelenteniük, amelyek különbsége az elfogadott tűréshatáron belül van, ahogy azt az adatgyűjtésről szóló szabályozástechnikai standardok melléklete részletesen meghatározza.
136. Az értékpapírok piaci értékét az egyes munkanapokon az üzletzáráskor fennálló értéknek megfelelően kell jelenteni, és ennek a biztosítékkezelési célokra, pl. a napi változó letét kiszámításához alkalmazott értékelést kell tükröznie.
137. Abban az esetben, ha az értékelendő értékpapírokhoz nem áll rendelkezésre piaci ár, az adatszolgáltatást végző szerződő félnek tartalék lehetőségként a rendelkezésre álló legfrissebb piaci árat kell használnia.
138. A szerződő feleknek az árra vonatkozó összes mező esetében megfelelő módon kell használniuk a pénznemre vonatkozó XML-címkéket, hogy megfelelően azonosítani lehessen a releváns érték- és összegmezőket, főleg akkor, ha ezek más pénznemben vannak. Lásd még az 5.2.1.8. szakaszban található példát.
139. Ha egy szerződő félnek devizaárfolyamot kell használnia a pontos értékelés benyújtásához, akkor a vonatkozó EKB-árfolyamot kell használni. Abban az esetben, ha az átváltáshoz nem áll rendelkezésre EKB-devizaárfolyam, a szerződő feleknek közösen kell megállapodniuk egymás között, hogy mely devizaárfolyamot használják értékelési és adatszolgáltatási célokra.

4.14 A CFI-kód jelentése biztosítékként használt értékpapír esetében

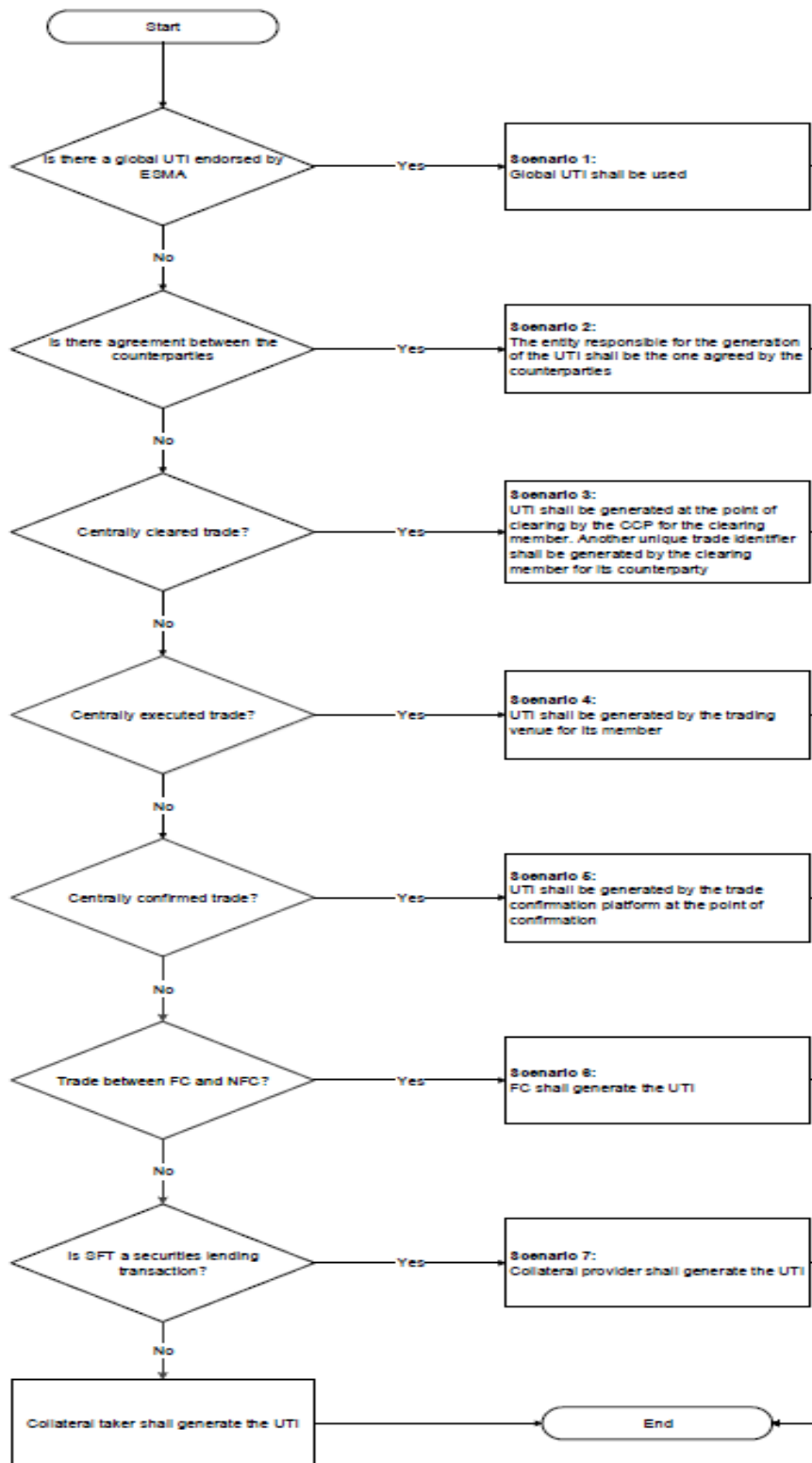
140. Ha értékpapírt használnak biztosítékként, akkor az adott értékpapír CFI-kódjáról adatot kell szolgáltatni a „Hitel- és biztosítéki adatok” táblázat 42. és 79. mezőjében. Ez a mező árukra nem vonatkozik.
141. A szerződő feleknek mindig hivatalos forrásokat kell használniuk a CFI-kód megállapításához. E célból a nemzeti kódkiadó szervezet által kiadott adatokat kell felhasználni. További információ az ANNA weblapján, a következő linken található: <http://www.anna-web.org/standards/about-identification-standards/>, vagy az adott értékpapír tekintetében illetékes nemzeti kódkiadó szervezettől kapható.
142. A szerződő felek csak érvényes CFI-kódokat jelenthetnek. Ha a hivatalos forrásokban nem található a CFI-kód, akkor arról a szerződő feleknek kell megállapodniuk, mivel a CFI-kód összeegyeztetendő mező.

4.15 Visszamenőleges adatszolgáltatás

143. Azon szerződő feleknek, amelyek úgy döntenek, hogy jelentést nyújtanak be egy előző RSD-ről, teljes és pontos adatokat kell szolgáltatniuk az adott visszamenőlegesen jelentett ügyletekről, ideértve a biztosíték „COLU” intézkedéstípusként való napi aktualizálását. Ha az értékpapír-finanszírozási ügyleteik egy részéről szolgáltatnak adatot, az adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardok mellékletének 3. és 4. táblázatában hiánytalan és pontos adatokat kell szolgáltatniuk a letétről és újrafelhasználásról.
144. Ha mindkét szerződő félre vonatkozik az adott RSD, akkor az egyeztetési eltérések minimalizálása érdekében meg kell egyezniük abban, hogy melyik napon hajtják végre az értékpapír-finanszírozási ügyletekről való visszamenőleges adatszolgáltatást. A visszamenőlegesen jelentett ügyletekről való adatszolgáltatást minden esetben RSD+190 napon belül el kell végezni. Ha egy adatszolgáltató szerződő fél, akire nézve az RSD még nem lépett hatályba, úgy dönt, hogy visszamenőlegesen szolgáltat adatot az ügyletekről, biztosítania kell, hogy minden egyes értékpapír-finanszírozási ügyletről a 146. bekezdésnek megfelelően szolgáltat adatot.
145. Ha a szerződő felek így döntenek, akkor önkéntes alapon továbbra is lehetőség van az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó teljes körű visszamenőleges adatszolgáltatásra is, azaz az összes olyan értékpapír-finanszírozási ügyletről való adatszolgáltatásra, amelyek nyitva vannak az első RSD után egy adott időpontban a fent említett határidő előtt.
146. A visszamenőlegesen jelentett ügyletet „NEWT” értékkel kitöltött intézkedéstípusként (2.98. mező) kell jelenteni. „A végrehajtás időbélyegzője” (2.12.) mezőbe az eredeti végrehajtási időbélyegzőt kell megadni. Az „Értéknapi (kezdőnap)” (2.13.) mezőbe az eredeti értéknapot kell beírni, kivéve, ha azt az értékpapír-finanszírozási ügylettel kapcsolatos kiegyenlítési problémák miatt módosították. A többi adatmezőnek az adatszolgáltatás időpontjában fennálló állapotot kell tartalmaznia. A korábbi életciklus-eseményekről nem szabad külön adatot szolgáltatni.

4.16 Egyedi ügyletazonosító létrehozása és felépítése

147. Az alábbi folyamatábra az egyedi ügyletazonosító létrehozásának folyamatát szemlélteti.



148. Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a központi szerződő fél és annak klíringtagjai, valamint a klíringtagok és azok ügyfelei közötti minden egyes értékpapír-finanszírozási ügyletről különböző egyedi ügyletazonosítókkal kell adatot szolgáltatni.

149. Érdemes megjegyezni, hogy a szerződő felek között az egyedi ügyletazonosítóról való megállapodás a gyakorlatban a technikai standardok által biztosított keretrendszeren belüli tartaléklehetőséget jelenti, mivel a legtöbb szervezet az egyedi ügyletazonosító létrehozásakor a többlépcsős megközelítésre támaszkodik. Mindazonáltal a feleknek lehet ilyen megállapodása, amely esetben a megállapodás hatálya alá tartozó valamennyi esetben annak megfelelően kell eljárniuk.
150. Nyílt lejáratú értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a szerződő feleknek meg kell tartaniuk az adott értékpapír-finanszírozási ügylethez eredetileg létrehozott egyedi ügyletazonosítót, és nem hozhatnak létre újat minden megújításkor.
151. Az olyan szerződő félnek, aki nem hoz létre egyedi ügyletazonosítót, képesnek kell lennie arra, hogy a rendszereibe vagy az adatszolgáltatásért felelős szervezet rendszereibe vagy az adatszolgáltatást végző szervezet rendszereibe beépítse az azon szerződő fél által közölt egyedi ügyletazonosítót, amely létrehozta azt.
152. A szerződő feleknek a megosztandó adatok mennyiségének megfelelő műszaki intézkedéseket kell bevezetniük, hogy biztosítsák az egyedi ügyletazonosító megfelelő időben történő közlését és beépítését. Amennyiben probléma merül fel az egyedi ügyletazonosító létrehozásával vagy közlésével kapcsolatban, a szerződő feleknek gondoskodniuk kell az egyedi ügyletazonosító létrehozásával és közlésével kapcsolatos bármely probléma időben történő megoldásáról, és az értékpapír-finanszírozási ügyletről való adatszolgáltatásra vonatkozó időbeli ütemezésnek megfelelően adatot kell szolgáltatniuk.
153. Ha maga az egyedi ügyletazonosító rossz, akkor az ügyletet törölni kell, és arról újként, a helyes egyedi ügyletazonosítóval kell adatot szolgáltatni.
154. Az egyedi ügyletazonosító formátumát illetően az értékpapír-finanszírozási ügyletben részt vevő szerződő felek fontolóra vehetik a CPMI-IOSCO útmutatásainak használatát, amely azt javasolja, hogy az új egyedi ügyletazonosítók a következők egymással összefűzött kombinációi legyenek:
 - a. a létrehozó szervezetnek a létrehozás pillanatában érvényes jogalany-azonosítója, és
 - b. az adott szervezet által létrehozott egyedi érték (ahol ennek az értéknek csak az adott szervezet által létrehozott értékek készletén belül kell egyedinek lennie, mivel a jogalany-azonosítóval történő összefűzés garantálja a globális szintű egyediséget).

4.17 A kedvezményezettek azonosítása és jelentése

155. A szokásos esetet – de lehetnek más esetek is – az átfogó és elkülönített alapok jelentik, ahol az átfogó alap a szerződő fél, az elkülönített alap vagy elkülönített alapok pedig a kedvezményezett(ek).

156. Előfordulhatnak olyan esetek is, amikor a kedvezményezett egy pénzügyileg elkülönített eszközkészlet; ilyen esetekben a jogalany-azonosítót kell használni a pénzügyileg elkülönített eszközkészlet azonosítására⁷.

4.18 Az értékpapír-kibocsátó és az értékpapírok azonosítása

157. A szerződő feleknek jelenteniük kell a kölcsönbe adott vagy kölcsönbe vett értékpapírok kibocsátójának/kibocsátóinak jogalany-azonosítóját, a biztosítékként felhasznált értékpapírok kibocsátójának/kibocsátóinak jogalany-azonosítóját, valamint az értékpapírok ISIN-kódjait.
158. Ezen információ bejelentésekor a szerződő feleknek gondoskodniuk kell arról, hogy az ellenőrzési szabályokkal összhangban az ISIN-kód és a kibocsátó jogalany-azonosítója megfeleljen egymásnak.

4.19A szerződő fél vállalati esemény alanyává válásakor követendő eljárás

159. Az új jogalany-azonosítóval rendelkező szervezetnek (például egyesített vagy felvásárló szervezet – a továbbiakban: „új szervezet”) értesítenie kell a változásról azon kereskedési adattár(aka)t, amely(ek)hez az értékpapír-finanszírozási ügyletéről adatot szolgáltatott, és kérnie kell a lezáratlan értékpapír-finanszírozási ügyleteknél feltüntetett azonosítójának aktualizálását az alábbi 162. bekezdés szerint. Ha az azonosító egyesülés vagy felvásárlás következtében változik meg, az egyesített vagy felvásárló jogalanyak megfelelően aktualizálnia kell a megszerzett/egyesített szervezet jogalany-azonosítójával kapcsolatos adatokat is. Adott esetben a szerződő félnek információkat kell szolgáltatnia az ország változásáról is.
160. Az összes fennálló értékpapír-finanszírozási ügyletet érintő vállalati átszervezési események esetén a kereskedési adattárnak azonosítania kell az összes olyan lezáratlan értékpapír-finanszírozási ügyletet, amelyeknél a szervezet azonosítása a régi jogalany-azonosítóval történik a következő mezők bármelyikében: adatszolgáltatást végző szerződő fél azonosítója, másik szerződő fél azonosítója, majd a régi jogalany-azonosítót ki kell cserélni az újra.
161. Más vállalati átszervezési események – többek között a részleges felvásárlások, kiválások – esetlegesen csak a lezáratlan értékpapír-finanszírozási ügyletek egy részhalmazát érintik. Ebben az esetben az új szervezetnek ennek megfelelően meg kell adnia a kereskedési adattárnak az adott esemény által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek egyedi ügyletazonosítóját.
162. Ez a következő irányított folyamat útján valósul meg:
- a. Az új szervezetnek írásbeli dokumentációt kell benyújtania azon kereskedési adattár(ak)hoz, amely(ek)hez az értékpapír-finanszírozási ügyletéről adatot

⁷ A Pénzügyi Stabilitási Tanács (FSB) „Globális jogalany-azonosító a pénzügyi piacok számára” című, 2012. évi jelentésének 8. számú ajánlásában említettek szerint az eszközkészletek vagy a jogi személyek más elkülönített részei külön jogok és kötelezettségek alanyai lehetnek az adott jogi személy megfelelő függetlenségének szintjén, és jogosultak lehetnek jogalany-azonosítóra. Ez összhangban van a jogi azonosítóra vonatkozó 17442:2012 ISO szabvánnyal is.

szolgáltatott, és kérnie kell a LEI megváltoztatását a vállalati esemény miatt. A dokumentációban az alábbi információkat kell egyértelműen feltüntetni i. az egyesülésben, felvásárlásban vagy más vállalati eseményben részt vevő szervezetek jogalany-azonosítói, ii. az új szervezet jogalany-azonosítója, iii. a változás bekövetkezésének dátuma, és iv. az érintett lezáratlan értékpapír-finanszírozási ügyletek egyedi ügyletazonosítói.

Egyesülés vagy felvásárlás esetén a dokumentációnak bizonyítékot vagy igazolást kell tartalmaznia arról, hogy a vállalati esemény megtörtént vagy meg fog történni, és azt megfelelően alá kell írni. A szervezetnek lehetőség szerint előre meg kell adnia a szükséges információkat, hogy a módosítás ne visszamenőlegesen, hanem a iii. pontban meghatározott dátummal történjen meg. Meg kell jegyezni, hogy az új jogalany-azonosító időben történő aktualizálásának elmulasztása a szervezet által benyújtott jelentések elutasítását eredményezné abban az esetben, ha azt korábban a régi jogalany-azonosítóval azonosították egy megfelelő státusszal (azaz „Kibocsátva”, „Átruházásra vár” vagy „Archiválásra vár”), és ezt a státuszt később „Egyesített” státuszra változtatták.

- b. A kereskedési adattáraknak továbbítania kell ezt az információt az összes többi kereskedési adattár részére egy külön fájlban, amelyben szerepel(nek) i. a régi jogalany-azonosító(k), ii. az új jogalany-azonosító(k) és iii. a változtatás elvégzésének dátuma. A fájlt lehetőség szerint előzetesen továbbítani kell, hogy a módosítás ne visszamenőlegesen, hanem a iii. pontban meghatározott dátummal történjen meg.
 - c. Ha az értékpapír-finanszírozási ügyletben az egyesített szervezetek bármelyikét azonosítják, az ilyen értékpapír-finanszírozási ügyletben részt vevő mindegyik szerződő felet köteles értesíteni a módosításról az a kereskedési adattár, amelynek adatot szolgáltatnak.
 - d. A kereskedési adattárak kötelesek értesíteni azokat a szabályozókat is, amelyek hozzáféréssel rendelkeznek az aktualizált értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatokhoz.
 - e. Adott esetben a kereskedési adattárnak aktualizálnia kell az 1.12. „A másik szerződő fél országa” mezőt.
 - f. A változásokat az egyes kereskedési adattárak által karbantartott adatszolgáltatási naplóban kell nyilvántartani.
163. A későbbi adatszolgáltatásokat a szokásos módon ellenőrizni kell a GLEIF-en keresztül, és el kell utasítani, ha az ellenőrzés sikertelen.
164. Ezért nem elvárható, hogy egy szervezet új jogalany-azonosító miatt adatszolgáltatást nyújtson be.
165. Nem kell követni a fent említett eljárást, ha a szerződő felek tévesen azonosítják magukat. Ebben az esetben „EROR” intézkedéstípusként kell értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó adatszolgáltatást benyújtaniuk, meg kell állapodniuk egy új egyedi ügyletazonosítóban a másik szerződő féllel, valamint hiánytalanul és pontosan adatot kell szolgáltatniuk az értékpapír-finanszírozási ügyletről.

4.20 Adatszolgáltatás a fokozatos bevezetési időszakban

166. Azoknak a szerződő feleknek, akik számára az adatszolgáltatási kötelezettség még nem kezdődött meg, az adatszolgáltatásról szóló technikai standardoknak megfelelően minden releváns információt meg kell adniuk azon szerződő félnek, aki számára az adatszolgáltatási kötelezettség már megkezdődött. Az adatszolgáltatást végző szerződő félnek átadandó információk 2 adatmezőből állnak. Ezek az adatmezők a „Másik szerződő fél”, „A másik szerződő fél fióktelepe” és „A másik szerződő fél országa”. Ezen adatmezők esetében az információkat kellő időben meg kell küldeni az adatszolgáltatást végző szerződő félnek.
167. Ha azok a szerződő felek, akik számára az adatszolgáltatási kötelezettség még nem kezdődött meg, egyszerűbbnek találják, az adatszolgáltatást illetően az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 33. cikke (2) bekezdésének a) pontjában megjelölt, vonatkozó kezdő időpont előtt megkezdhetik az adatszolgáltatást. Ha valamely szerződő fél, aki számára az adatszolgáltatási kötelezettség még nem kezdődött meg, úgy dönt, hogy adatot szolgáltat az ügyletekről, akkor az iránymutatások 4.15. szakaszának 144. bekezdését kell követnie.

5 Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti mezők táblázatai

168. Az adatszolgáltatásról szóló szabályozástechnikai standardok 1. cikkének (1) bekezdése előírja, hogy „A konkrét értékpapír-finanszírozási ügylet tekintetében az (EU) 2015/2365 rendelet 4. cikkének (1) bekezdése szerinti adatszolgáltatásnak a melléklet 1., 2., 3. és 4. táblázatában előírt hiánytalan és pontos adatokat kell tartalmaznia.” Az 5.1–5.6. szakaszban szereplő felhasználási esetek nem feltétlenül tartalmazzák az érintett értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó összes mezőt, de az adatmezők meghatározott szakaszaira összpontosítanak annak érdekében, hogy pontosabb és részletesebb útmutatást nyújtsanak az adatszolgáltatásról más adatelemek szükségtelen megisméltése vagy bevonása nélkül.
169. Az ellenőrzési szabályok tartalmazzák a teljes útmutatást az alkalmazandó mezőkre vonatkozóan az értékpapír-finanszírozási ügyletek típusaiként, intézkedéstípusonként és szintenként, valamint a vonatkozó függőségeket is.
170. A következő szakaszok különféle forgatókönyveket és a hozzájuk tartozó táblázatokat tartalmaznak, egyértelműsítve az e forgatókönyvekhez kapcsolódó adatszolgáltatás módját. Mindegyik táblázat az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet technikai standardjai szerinti adatszolgáltatási mezőket mutatja. A „Mező” oszlop az egyes mezők nevét mutatja, a „Példa” oszlop pedig példával szolgál arra, hogy mit kell szerepeltetni abban a mezőben. Az „XML-üzenet” elnevezésű utolsó oszlop az XML-üzenet formátumát mutatja, amelyet be kell küldeni a kereskedési jelentésben.
171. Az adott forgatókönyvben jelzett ellenkező értelmű rendelkezés hiányában az alábbi háttérinformáció az 5. szakaszban ismertetett összes forgatókönyvre vonatkozik:

„A” szerződő fél egy pénzügyi szerződő fél, amelynek jogalany-azonosítója 12345678901234500000

„B” szerződő fél egy francia pénzügyi szerződő fél, amelynek jogalany-azonosítója ABCDEFGHIJKLMNOPQRST

„C” szerződő fél egy kkv nem pénzügyi szerződő fél, amelynek jogalany-azonosítója 123456789ABCDEFGHIJK

„D” szerződő fél jogalany-azonosítója 11223344556677889900

„E” bróker jogalany-azonosítója 88888888888888888888

„F” kölcsönnyújtó ügynök jogalany-azonosítója BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB

„G” három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök jogalany-azonosítója 77777777777777777777

„H” letétkezelő bank jogalany-azonosítója AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA

„I” harmadik fél adatszolgáltatási szolgáltatásokat kínál, jogalany-azonosítója 12345123451234512345

„J” szerződő fél klíringtagként is eljár, jogalany-azonosítója CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC

„K” ÁÉKBV alap jogalany-azonosítója UUUUUUUUUU1111111111, „L” ÁÉKBV alapkezelő társaság jogalany-azonosítója pedig UUUUUUUUUU2222222222

„M” ABA jogalany-azonosítója AAAAAAAAAA1111111111, „N” ABA alapkezelő társaság jogalany-azonosítója pedig AAAAAAAAAA2222222222

„O” központi szerződő fél jogalany-azonosítója BBBBBBBBBB1111111111

A német értékpapír-kibocsátó jogalany-azonosítója NNNNNNNNNNNNNNNNNNNN

A spanyol értékpapír-kibocsátó jogalany-azonosítója EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE

A francia értékpapír-kibocsátó jogalany-azonosítója FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF

A holland értékpapír-kibocsátó jogalany-azonosítója DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD

Az olasz értékpapír-kibocsátó jogalany-azonosítója IIIIIIIIIIIIIIIIIIIII

Egy általános értékpapír-kibocsátó jogalany-azonosítója GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG

A főbb tőzsdeindexben szereplő részvények francia kibocsátójának jogalany-azonosítója 529900S21EQ1BO4ESM68

„P” kereskedési helyszín azonosítója MIC XWAR

Az értékpapírok azonosításához a következő ISIN-kódokat használják:

- a. Német kötvények (hagyományos): DE0010877643
- b. Spanyol lejárat nélküli kötvények: ES0010877643
- c. Francia kötvények: FR0010877643
- d. Holland kötvények: NL0010877643
- e. Főbb tőzsdeindexben szereplő francia részvények: FR0000120271
- f. Más francia értékpapírok: FR0010877000
- g. Biztosítékkosár: GB00BH4HKS39
- h. 1. biztosíték-összetevő: IT00BH4HKS39
- i. 2. biztosíték-összetevő: FR00BH4HKS39

Az értékpapírok besorolásához használt CFI-kódok a következők:

- a. Hagományos államkötvény: DBFTFR
- b. Lejárat nélküli államkötvény: DBFTPR
- c. Tulajdonjogot megtestesítő értékpapírok: ESVUFN

A táblázatokban látható üres és kiszürkített mezőket nem kell alkalmazni az adott konkrét példában, csak az egyértelműség végett szerepelnek.

A felhasználási eseteknek az értékpapír-finanszírozási ügylet különféle típusaira való alkalmazhatósága is szerepel. Az ISO 20022 szabvány szerinti XML-sémáknak megfelelő tényleges adatszolgáltatás szintén meg van adva.

5.1 A szerződő fél adatai

- 172. Egy értékpapír-finanszírozási ügylet elszámolásakor minden szerződő félnek jelentenie kell klíringtagját a klíringtag mezőben.
- 173. Ha az adatszolgáltatás önkéntes átruházásának vagy a felelősség megosztásának esete áll fenn, az adatszolgáltatást végző szervezetnek vagy az adatszolgáltatásért felelős szervezetnek külön kell benyújtania a szerződő félre vonatkozó adatokat, valamint az adatszolgáltatás által érintett mindkét félre vonatkozóan be kell nyújtania a hitel- és biztosítékadatokat.
- 174. Olyan felhasználási eseteknél, amelyek az alábbiakban felsoroltak közül két vagy több felhasználási esetet is lefednek, az adatszolgáltató szerződő feleknek vagy az adatszolgáltatásért felelős szervezeteknek az alábbi útmutatás alapján abba az összes vonatkozó adatot bele kell foglalniuk.

7. táblázat – Felhasználási esetek

| | Repo and reverse repo | BSB / SBB | Securities and commodities lending | Margin lending |
|---|-----------------------|-----------|------------------------------------|----------------|
| Non-cleared bilateral SFT between headquarters | Y | Y | Y | Y |
| Non-cleared bilateral SFT between branches | Y | Y | Y | Y |
| Non-cleared bilateral SFT with beneficiaries | Y | Y | Y | N |
| Non-cleared SFT with brokers, settled with a custodian bank | Y | Y | Y | N |
| Non-cleared SFT with broker, agent lender and tri-party agent | Y | Y | Y | N |
| Non-cleared SFT with broker, agent lender and tri-party agent, settled with a CSD participant different from any of the entities and voluntary delegation of reporting to a third party | Y | Y | Y | N |
| Cleared SFT with broker, agent lender, tri-party agent | Y | Y | Y | N |
| Cleared SFT with broker, agent lender, tri-party agent settled with a CSD participant different from any of the entities and voluntary delegation of reporting to a third party | Y | Y | Y | N |
| Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund | Y | Y | Y | Y |

7. táblázat – Felhasználási esetek

| | Repo and reverse repo | BSB / SBB | Securities and commodities lending | Margin lending |
|---|-----------------------|-----------|------------------------------------|----------------|
| Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITS management company delegates reporting to a third party | Y | Y | Y | Y |
| Non-cleared SFTs concluded by AIF | Y | Y | Y | Y |
| Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced | Y | Y | Y | Y |

5.1.1 El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügyletek a vállalatközpontok között

175. A 8. táblázat megmutatja, hogy milyen típusú értékpapír-finanszírozási ügyletek köthetők meg tisztán kétoldalúan két vállalatközpont között.

8. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | Y |

176. A 9. táblázat olyan kétoldalú ügyletekről való adatszolgáltatást szemléltet, amelyben az adatszolgáltató szerződő fél („A” szerződő fél) szintén benyújtja a saját adatszolgáltatásait (azaz nincs külön adatszolgáltatást végző szervezet). „A” szerződő fél ennek az ügyletnek a kedvezményezettje és egyben a központi értéktár résztvevője.

9. táblázat – EI nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügyletek a vállalatközpontok között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|-------------------------|--|
| 1 | Reporting timestamp | 2021-02-01T15:15:15Z | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty A | ... <CtrPtyData> |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 6 | Additional sector classification | | <LEI>12345678901234500000</LEI> |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | </Id> <Ntr> |
| 8 | Branch of the other counterparty | | <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> |
| 9 | Counterparty side | GIVE | </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 12 | Country of the other Counterparty | FR | </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> |
| 13 | Beneficiary | | <NttyRspnsblForRpt> |
| 14 | Tri-party agent | | <LEI>12345678901234500000</LEI> |
| 15 | Broker | | </NttyRspnsblForRpt> |
| 16 | Clearing member | | <OthrPtyData> <SttlmPties> |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of counterparty A | <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> |
| 18 | Agent lender | | </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... |

9. táblázat – El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügyletek a vállalatközpontok között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.1.2 El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet fióktelepek között

10. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | Y |

177. A 11. táblázat két szerződő fél fióktelepei között létrejött kétoldalú ügyletekről való adatszolgáltatásra mutat egy példát. A szervezeteket (vállalatközpontokat) a vonatkozó jogalany-azonosítókkal azonosítják, míg a fióktelepek országait ISO országcódokkal azonosítják. „A” szerződő fél a központi értéktár résztvevője is egyben.

11. táblázat – El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet fióktelepek között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------------------|-------------------------|--|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty A | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | |
| 6 | Additional sector classification | | |

11. táblázat – EI nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet fióktelepek között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|-------------------------|---|
| 7 | Branch of the reporting counterparty | FR | <pre> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Brnch> <Ctry>FR</Ctry> </Brnch> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> </pre> |
| 8 | Branch of the other counterparty | DE | |
| 9 | Counterparty side | GIVE | |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | |
| 12 | Country of the other Counterparty | FR | |
| 13 | Beneficiary | | |
| 14 | Tri-party agent | | |
| 15 | Broker | | |
| 16 | Clearing member | | |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of counterparty A | |
| 18 | Agent lender | | |

5.1.3 El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet kedvezményezettekkel

| 12. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek | | | |
|---|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
| Y | Y | Y | N |

178. A 13. táblázat olyan kétoldalú, el nem számolt ügyletre mutat egy példát, amelyben „A” szerződő fél nem kedvezményezettje az ügyletnek. A kedvezményezett a „D” szerződő fél. „A” szerződő fél a központi értéktár résztvevője is egyben.

| 13. táblázat – El nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet kedvezményezettekkel | | | |
|---|--------------------------------------|-------------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> </CtrPtyData> </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty A | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | |
| 6 | Additional sector classification | | |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | |
| 8 | Branch of the other counterparty | | |
| 9 | Counterparty side | GIVE | |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | |
| 12 | Country of the other Counterparty | FR | |

| 13. táblázat – EI nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet kedvezményezettekkel | | | |
|---|---|-------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 13 | Beneficiary | {LEI} of counterparty D | <pre> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> </pre> |
| 14 | Tri-party agent | | <pre> <LEI>1234567890123450000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <Bnfcry> </pre> |
| 15 | Broker | | |
| 16 | Clearing member | | |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of counterparty A | |
| 18 | Agent lender | | <pre> <LEI>11223344556677889900</LEI> </Bnfcry> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>1234567890123450000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.1.4 EI nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet brókerekkel, amelyet letétkezelő bank egyenlíti ki

| 14. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek | | | |
|---|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
| Y | Y | Y | N |

179. A 15. táblázat által szemléltetett forgatókönyvben „A” szerződő fél ügyletet köt „B” szerződő féellel. „A” szerződő fél „H” letétkezelő bankot veszi igénybe, amelyet ezért az

1.17. mezőben fel kell tüntetni. Ezenkívül „A” szerződő fél igénybe veszi „E” bróker szolgáltatásait.

| 15. táblázat – EI nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet brókerekkel, letétkezelő bankkal kiegyenlítve | | | |
|--|---|---------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-0115:15:15Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </Rpt> </New> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty A | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | |
| 6 | Additional sector classification | | |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | |
| 8 | Branch of the other counterparty | | |
| 9 | Counterparty side | GIVE | |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | |
| 12 | Country of the other Counterparty | FR | |
| 13 | Beneficiary | | |
| 14 | Tri-party agent | | |
| 15 | Broker | {LEI} of broker E | |
| 16 | Clearing member | | |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of custodian bank H | |
| 18 | Agent lender | | |

15. táblázat – El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet brókerekkel, letétkezelő bankkal kiegyenlítve

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </SttImPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.1.5 El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között

16. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | N |

180. A 17. táblázat által szemléltetett forgatókönyv szerint „A” szerződő fél ügyletet köt „B” szerződő féllel. „A” szerződő fél „F” kölcsönnyújtó ügynököt és „G” három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynököt veszi igénybe. Ezen túlmenően „A” szerződő fél igénybe veszi „E” bróker szolgáltatásait. „A” szerződő fél a központi értéktár résztvevője.

17. táblázat – El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------|-------------------------|--|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... </New> <CtrPtyData> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty A | |

17. táblázat – El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|----------------------------|---|
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 6 | Additional sector classification | | <LEI>12345678901234500000</LEI> |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | </Id> <Ntr> |
| 8 | Branch of the other counterparty | | <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> |
| 9 | Counterparty side | GIVE | </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> |
| 13 | Beneficiary | | <NttyRspnsblForRpt> |
| 14 | Tri-party agent | {LEI} of tri-party agent G | <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 15 | Broker | {LEI} of broker E | <OthrPtyData> <TrptyAgt> |
| 16 | Clearing member | | <LEI>TTTTTTTTTTTTTTTTTTTT</LEI> </TrptyAgt> |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of counterparty A | <Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> |
| 18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> |

17. táblázat – El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.1.6 El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig önkéntesen harmadik félre ruházzák át.

18. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | N |

181. A 19. táblázat által szemléltetett forgatókönyv szerint „A” szerződő fél ügyletet köt „B” szerződő féellel. „A” szerződő fél „F” kölcsönnyújtó ügynököt és „G” három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynököt veszi igénybe. Ezen túlmenően „A” szerződő fél igénybe veszi „E” bróker és „H” letétkezelő bank szolgáltatásait. Végül pedig „A” szerződő fél az adatszolgáltatást „I” harmadik félre ruházza át.

19. táblázat – El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig harmadik félre ruházzák át.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------|------------------------|--|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-0115:15:15Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of third party I | |

19. táblázat – EI nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig harmadik félre ruházzák át.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|----------------------------|---|
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | <LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 6 | Additional sector classification | | |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> |
| 8 | Branch of the other counterparty | | <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> |
| 9 | Counterparty side | GIVE | <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | <OthrCtrPty> <Id> |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> |
| 13 | Beneficiary | | <NttyRspnsblForRpt> |
| 14 | Tri-party agent | {LEI} of tri-party agent G | |
| 15 | Broker | {LEI} of Broker E | <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> |
| 16 | Clearing member | | |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of custodian bank H | <TrptyAgt> <LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr> |
| 18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> |

19. táblázat – El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig harmadik félre ruházzák át.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB </LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.1.7 Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között

20. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | N |

182. A 21. táblázat az adatszolgáltatási mezők elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet esetén történő kitöltését szemlélteti. A mezők kitöltése független attól, hogy a szerződő fél milyen típusú hozzáféréssel rendelkezik a központi szerződő félhez. Mindig meg kell határozni a klíringtagként eljáró szervezetet.

183. „A” szerződő fél „J” klíringtag útján fér hozzá a központi szerződő félhez. Ezenkívül „E” bróker, „F” kölcsönnyújtó ügynök és „G” három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök szolgáltatásait is igénybe veszi. „A” szerződő fél a központi értéktár résztvevője is egyben.

184. Meg kell jegyezni, hogy a központi szerződő fél mező a 2. táblázatra (Hitel- és biztosítékadatok) vonatkozik, és ezért kitöltését az 5.2. szakasz tárgyalja.

21. táblázat – Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|----------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty A | <Rpt> <New> |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | <RptSubmitgNtty> |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> |
| 6 | Additional sector classification | | <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> |
| 8 | Branch of the other counterparty | | <Ntr> <FI> |
| 9 | Counterparty side | GIVE | <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> |
| 13 | Beneficiary | | </OthrCtrPty> |
| 14 | Tri-party agent | {LEI} of tri-party agent G | <NttyRspnsblForRpt> |
| 15 | Broker | {LEI} of broker E | <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 16 | Clearing member | {LEI} of counterparty J | <OthrPtyData> |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of counterparty A | <TrptyAgt> <LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> |
| 18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <Brkr> <ClrMmb> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> |

21. táblázat – Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök között

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </ClrMmb> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234512345</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB </LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.1.8 Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig harmadik félre ruházzák át.

22. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | N |

185. Az előző példához hasonlóan a 23. táblázat az adatszolgáltatási mezők elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet esetén történő kitöltését szemlélteti; „A” szerződő fél „J” klíringtag útján fér hozzá a központi szerződő félhez. Ezenkívül „E” bróker, „F” kölcsönnyújtó ügynök és a „G” három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök szolgáltatásait is igénybe veszi. Továbbá ebben a példában az ügyletet mindegyik

szereződő féltől eltérő „H” szervezettel egyenlítik ki, az adatszolgáltató szerződő fél pedig az adatszolgáltatást „I” harmadik félre ruházza át.

186. Meg kell jegyezni, hogy a mezők kitöltése független attól, hogy a szerződő fél milyen típusú hozzáféréssel rendelkezik a központi szerződő félhez. Mindig meg kell határoznia a klíringtagként eljáró szervezetet.

23. táblázat – Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet bróker, kölcsönnyújtó ügynök és három résztvevős szolgáltatást kínáló ügynök részvételével, amelyet a szervezetek mindegyikétől eltérő, a központi értéktár résztvevőjével egyenlítenek ki, az adatszolgáltatást pedig harmadik félre ruházzák át.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------------------|----------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01- 01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtrCd>FR</CtrCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <TrptyAgt> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of third party I | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | CDTI | |
| 6 | Additional sector classification | | |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | |
| 8 | Branch of the other counterparty | | |
| 9 | Counterparty side | GIVE | |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | |
| 13 | Beneficiary | | |
| 14 | Tri-party agent | {LEI} of tri-party agent G | |
| 15 | Broker | {LEI} of broker E | |
| 16 | Clearing member | {LEI} of counterparty J | |

5.1.9 ÁÉKBV alap által kötött el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

| 24. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek | | | |
|---|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
| Y | Y | Y | Y |

187. A 25. táblázat „K” ÁÉKBV alap által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletről való adatszolgáltatást mutatja be. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikke (3) bekezdésének megfelelően „L” ÁÉKBV alapkezelő társaság felel az ÁÉKBV nevében történő adatszolgáltatásért, ezért azt mind a 2.2. „Adatszolgáltatást végző szervezet”, mind a 2.10. „Adatszolgáltatásért felelős szervezet” mezőben azonosítják. Az ügyletet „H” letétkezelő bankkal egyenlítik ki.

| 25. táblázat – ÁÉKBV alap által kötött el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek | | | |
|--|--------------------------------------|-------------------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>UUUUUUUUUUU2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>UUUUUUUUUUU1111111111</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of UCITS management company L | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of UCITS K | |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | UCIT | |
| 6 | Additional sector classification | | |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | |
| 8 | Branch of the other counterparty | | |
| 9 | Counterparty side | GIVE | |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of UCITS management company L | |

| 25. táblázat – ÁÉKBV alap által kötött el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek | | | |
|--|---|---------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> |
| 13 | Beneficiary | | <NttyRspnsblForRpt> |
| 14 | Tri-party agent | | <LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI> |
| 15 | Broker | | </NttyRspnsblForRpt> |
| 16 | Clearing member | | <OthrPtyData> <SttlmPties> |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of custodian bank H | <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> |
| 18 | Agent lender | | </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> |

5.1.10 ÁÉKBV alap által megkötött, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek, ahol az ÁÉKBV alapkezelő társaság harmadik félre ruházza át az adatszolgáltatást

| 26. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek | | | |
|---|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
| Y | Y | Y | Y |

188. A 27. táblázat a „K” ÁÉKBV alap által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletről való adatszolgáltatást mutatja be. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4.3. cikkének megfelelően „L” ÁÉKBV alapkezelő társaság felel az ÁÉKBV nevében történő adatszolgáltatásért, ezért azt a 2.10. „Adatszolgáltatásért felelős szervezet” mezőben azonosítják, azonban úgy dönt, hogy az adatszolgáltatást „I” harmadik félre ruházza át, amelyet a 2.2. „Adatszolgáltatást végző szervezet” mezőben kell azonosítani. Az ügyletet „H” letétkezelő bankkal egyenlíti ki.

27. táblázat – ÁÉKBV alap által kötött el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|-------------------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>UUUUUUUUUUU1111111111</LEI> </Id> <Ntr> <FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn> </FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>UUUUUUUUUUU2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <StlImPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of third party I | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of UCITS K | |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | UCIT | |
| 6 | Additional sector classification | | |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | |
| 8 | Branch of the other counterparty | | |
| 9 | Counterparty side | GIVE | |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of UCITS management company L | |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | |
| 13 | Beneficiary | | |
| 14 | Tri-party agent | | |
| 15 | Broker | | |
| 16 | Clearing member | | |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of custodian bank H | |

27. táblázat – ÁÉKBV alap által kötött el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------|---------|---|
| 18 | Agent lender | | <pre> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.1.11 ABA által kötött, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

28. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | Y |

189. A 29. táblázat az „M” ABA által kötött értékpapír-finanszírozási ügyletről való adatszolgáltatást mutatja be. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4.3. cikkének megfelelően „N” ABA alapkezelő társaság felel az ABA nevében történő adatszolgáltatásért, ezért azt mind a 2.2. „Adatszolgáltatást végző szervezet”, mind a 2.10. „Adatszolgáltatásért felelős szervezet” mezőben azonosítják. Az ügyletet „H” letétkezelő bankkal egyenlítik ki.

29. táblázat – ABA által kötött, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------|-----------------------------------|--|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> </pre> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of AIF management company N | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of AIF M | |

29. táblázat – ABA által kötött, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|-----------------------------------|--|
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | AIFD | <LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty> |
| 6 | Additional sector classification | | <CtrPtyData> <RptgCtrPty> |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | <Id> |
| 8 | Branch of the other counterparty | | <LEI>AAAAAAAAAA1111111111</LEI> </Id> |
| 9 | Counterparty side | GIVE | <Ntr> <FI> |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of AIF management company N | <Clssfctn>AIFD</Clssfctn> </FI> |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 13 | Beneficiary | | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> |
| 14 | Tri-party agent | | <CtryCd>FR</CtryCd> |
| 15 | Broker | | </OthrCtrPty> |
| 16 | Clearing member | | <NttyRspnsblForRpt> |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of custodian bank H | <LEI>AAAAAAAAAA2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> |
| 18 | Agent lender | | <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> |

29. táblázat – ABA által kötött, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|-------------------------|
| | | | </SctiesFincgRptgTxRpt> |

5.1.12 El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek, amelyek esetében az alap portfóliókezelését kiszervezik

190. A portfóliókezelésnek az alapkezelő társaságtól eltérő szervezethez való kiszervezése esetén ezt a szervezetet csak brókerként kell jelenteni, amennyiben ilyenként jár el. Ellenkező esetben ezt a szervezetet, hasonlóan más olyan szervezetekhez, amelyek közvetlenül vagy közvetve részt vehetnek az értékpapír-finanszírozási ügyletben, egyetlen mezőben sem kell jelenteni.
191. A 31. táblázatban bemutatott forgatókönyv szerint „M” ABA portfóliókezelését egy másik szervezetre ruházza át, amely nem brókerként jár el. Az ügyletet „H” letétkezelő bankkal egyenlítki ki.

30. táblázat – A felhasználási eset által érintett értékpapír-finanszírozási ügyletek

| Repo and reverse repo | Buy sell back/sell buy-back | Securities and commodities lending | Margin lending |
|-----------------------|-----------------------------|------------------------------------|----------------|
| Y | Y | Y | Y |

31. táblázat – El nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek, amelyek esetében az alap portfóliókezelését kiszervezik

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------------------|-----------------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-01-01T15:15:15Z | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty> <LEI>AAAAAAAAAAAA2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>AAAAAAAAAAAA1111111111</LEI> </Id> <Ntr> <FI> |
| 2 | Report submitting entity | {LEI} of AIF management company N | |
| 3 | Reporting counterparty | {LEI} of AIF M | |
| 4 | Nature of the reporting counterparty | F | |
| 5 | Sector of the reporting counterparty | AIFD | |
| 6 | Additional sector classification | | |
| 7 | Branch of the reporting counterparty | | |
| 8 | Branch of the other counterparty | | |

31. táblázat – EI nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletek, amelyek esetében az alap portfóliókezelését kiszervezik

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|-----------------------------------|---|
| 9 | Counterparty side | GIVE | <Clssfctn>AIFD</Clssfctn> </FI> |
| 10 | Entity responsible for the report | {LEI} of AIF management company N | </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> |
| 11 | Other counterparty | {LEI} of counterparty B | <OthrCtrPty> <Id> |
| 12 | Country of the other counterparty | FR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd> |
| 13 | Beneficiary | | </OthrCtrPty> |
| 14 | Tri-party agent | | <NttyRspnsblForRpt> |
| 15 | Broker | {LEI} of AIF management company N | <LEI>AAAAAAAAA222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 16 | Clearing member | | <OthrPtyData> <Brkr> |
| 17 | Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant | {LEI} of custodian bank H | <LEI> AAAAAAAAA222222222</LEI> </Brkr> |
| 18 | Agent lender | | <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> |

5.2 Hitel- és biztosítékadatok

192. Az iránymutatás azt is tartalmazza, hogy a különböző felhasználási esetekben a szerződő félre vonatkozó adatmezők kitöltését követően mely hitelre és a biztosítékra vonatkozó mezőket kell kitölteni. Az ISO 20002 szabvány szerinti XML-sémáknak megfelelő adatszolgáltatás is meg van adva. Ez megkönnyíti a mezők szerződő felek általi kitöltését.

193. Mindegyik alszakasz rövid leírást tartalmaz a tárgyalt mezők adatszolgáltatási logikájáról.

5.2.1 Az intézkedéstípusok ügylet- és pozíciószintű jelentése.

5.2.1.1 Új, el nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszinten

194. A 32. táblázat az adatszolgáltatási mezők új, el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügylet esetén történő kitöltését szemlélteti. Így kell ügyletszinten adatot szolgáltatni a kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügyletekről.

| 32. táblázat – Új, el nem számolt kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszinten | | | |
|--|-------------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UT11 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <ClrSts> <NonClrd>NORE</NonClrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 5 | Cleared | false | |
| 98 | Action type | NEWT | |
| 99 | Level | TCTN | |

5.2.1.2 Új kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszinten, amelynek elszámolása i. ugyanazon a napon vagy ii. azt követően történik.

195. A 33., 34. és 35. táblázat az adatszolgáltatási mezők szerződő fél (nem a központi szerződő fél) általi kitöltését szemlélteti olyan új értékpapír-finanszírozási ügylet esetében, ahol az ügyletet i. kétoldalúan hajtják végre és ezt követően ugyanazon a napon számolják el vagy ii. az ügylet megkötésének napját követő valamely napon számolják el egy kereskedési helyen. A szerződő feleknek értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó adatszolgáltatást kell benyújtaniuk „ETRM” intézkedéstípusként, amely nem engedi az

„Elszámolva” mező kitöltését annak jelzése érdekében, hogy az el nem számoltként jelentett ügyletet idő előtt lezárták. Ezt követően a szerződő félnek értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó adatszolgáltatást kell benyújtania „NEWT” intézkedéstípusként annak jelzésére, hogy az értékpapír-finanszírozási ügylet elszámolása megtörtént. A beküldések sorrendjét a 33., 34. és 35. táblázat szemlélteti.

| 33. táblázat – Új kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszinten, amelynek elszámolása ugyanazon a napon vagy azt követően történik. | | | |
|--|-------------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UT11 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> |
| 5 | Cleared | false | |
| 98 | Action type | NEWT | |
| 99 | Level | TCTN | ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </RpTrad> <ClrSts> <NonClrd>NORE</NonClrd> </ClrSts> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |

| 34. táblázat – Kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet lezárása ügyletszinten ugyanazon a napon vagy azt követően történő elszámolás miatt. | | | |
|--|-------------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UT11 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <EarlyTermntn> |
| 98 | Action type | ETRM | |
| 99 | Level | | |
| | | | ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </LnData> <CollData> |

34. táblázat – Kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet lezárása ügyletszinten ugyanazon a napon vagy azt követően történő elszámolás miatt.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> ... </CollData> ... </EarlyTermtn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

35. táblázat – Valamely kétoldalú értékpapír-finanszírozási ügylet ugyanazon a napon vagy azt követően történő elszámolásából eredő új, elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszinten.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|-------------------|--|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI2 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 2 | Report tracking number | UTI1 ⁸ | |
| 5 | Cleared | true | |
| 98 | Action type | NEWT | |
| 99 | Level | TCTN | |

196. Vegye figyelembe, hogy 33. és 34. táblázat szerinti adatszolgáltatásra nincs szükség, ha az ügyletet valamely kereskedési helyen olyan szerződő felek kötik meg, amelyek a klíringtagok is, és azt egy központi szerződő fél számolja el ugyanazon a napon; ilyenkor

⁸ A klíringtag ügyfél szempontjából, nem vonatkozik a központi szerződő fél általi adatszolgáltatásra.

csak a 35. táblázat szerinti adatszolgáltatásra van szükség. Ezenkívül a 35. táblázat abban az esetben nyújtandó adatszolgáltatást szemlélteti, ha egy elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet nem kerül azonnal be egy pozícióba (amely esetben POSC intézkedéstípusként jelentenek, ahogyan az a következő példából kiderül).

5.2.1.3 A pozíció-összetevőként jelentett új értékpapír-finanszírozási ügylet

197. A 36. és 37. táblázat az adatszolgáltatási mezők olyan esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor az új értékpapír-finanszírozási ügyletről⁹ pozíció-összetevőként szolgáltatnak adatot. Így lehet adatot szolgáltatni a központi szerződő fél által elszámolt pozícióban foglalt értékpapír-finanszírozási ügyletekről. Látható, hogy a 36. és 37. táblázatban megjelenített sorozatokat annak figyelembevételével alakították ki, hogy az értékpapír-finanszírozási ügyletet valamely kereskedési helyen kötik, és azt a központi szerződő fél ugyanazon a napon elszámolja, ezért csak az értékpapír-finanszírozási ügyletről kell adatot szolgáltatni annak elszámolt formájában. A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó példákban ezen ügyletek azonosítása „PUTI1” egyedi ügyletazonosítóval (UTI) történik.
198. Mivel ez az opció az ügyletszinthez képest kiegészítő adatszolgáltatást jelent, az adatszolgáltatás a következőképpen történik. A szerződő felek nem jelenthetik az adatszolgáltatás azonosító számát (2.2. mező) a központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében:

| 36. táblázat – Kereskedési helyszínen kötött, a központi szerződő fél által ugyanazon a napon elszámolt új értékpapír-finanszírozási ügylet, amelyről ügyletszinten pozíció-összetevővel szolgáltatnak adatot | | | |
|---|-------------------------------|--------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI1 | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <PosCmpnt> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </pre> |
| 5 | Cleared | true | |
| 98 | Action type | POSC ¹⁰ | |
| 99 | Level | TCTN | |

⁹ Az elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó forgatókönyvek esetében ugyan feltüntettük, hogy azok repoügyletekre is alkalmazhatók, de a gyakorlatban nem várhatók ilyen forgatókönyvek. Pozíciószint nem lehetséges értékpapírügylethez kapcsolódó hitel esetén.

¹⁰ Vegye figyelembe, hogy a ügyletszintű eredeti ügyletekről „pozíció-összetevő” intézkedéstípusként kell adatot szolgáltatni.

36. táblázat – Kereskedési helyszínen kötött, a központi szerződő fél által ugyanazon a napon elszámolt új értékpapír-finanszírozási ügylet, amelyről ügyletszinten pozícióösszetevővel szolgáltatnak adatot

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </PosCmpnt> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

37. táblázat – A központi szerződő fél által elszámolt, pozíciószinten jelentett új értékpapír-finanszírozási ügylet

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|--------------------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | PUTI1 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>PUTI1</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </New> </Rpt> </pre> |
| 5 | Cleared | true ¹¹ | |
| 98 | Action type | NEWT ¹² | |
| 99 | Level | PSTN ¹³ | |

¹¹ Annak ellenére, hogy van ilyen választási lehetőség, a kétoldalú megállapodás tárgyát képező értékpapír-finanszírozási ügyletek nem helyettesíthetők egyetlen ügylettel, ezért az összes pozíciószintű adatszolgáltatást el kell számolni.

¹² Ebben a példában új pozíciót hoznak létre. Abban az esetben, ha elszámolt ügyletet foglalnak bele egy meglévő pozícióba, akkor arról e pozíció módosításaként kell adatot szolgáltatni (MODI intézkedéstípusként).

¹³ Vegye figyelembe, hogy az így kapott elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletről pozíciószinten kell adatot szolgáltatni, és a pozíciószintű adatszolgáltatást csak az ügyletszintű adatszolgáltatás kiegészítéseként lehet alkalmazni, tehát a 36. és a 37. táblázat kapcsán adatszolgáltatásra van szükség.

37. táblázat – A központi szerződő fél által elszámolt, pozíciószinten jelentett új értékpapír-finanszírozási ügylet

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre></TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt></pre> |

5.2.1.4 Az értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszintű módosítása

199. A 38. táblázat az adatszolgáltatási mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, ha egy korábban jelentett értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszinten módosul.

38. táblázat – Az értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszintű módosítása

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|--|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI1 | <pre><SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt></pre> |
| 98 | Action type | MODI | |
| 99 | Level | TCTN | |

5.2.1.5 A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet pozíciószintű módosítása

200. A 39. táblázat az adatszolgáltatási mezők olyan központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet módosítása esetén történő kitöltését szemlélteti, akiről korábban pozíciószinten szolgáltatott adatot. Ez olyan további értékpapír-finanszírozási ügyletek bekerüléséből fakad, amelyeket ügyletszinten kötöttek és ugyanazon a napon vagy egy másik napon valamely központi szerződő fél elszámolt. Miután az ügylet bekerült a pozícióba, nincs lehetőség az eredeti ügyletszintű adatszolgáltatás módosítására, azonban ha bármilyen információt tévesen jelentettek, akkor az értékpapír-finanszírozási ügylet helyesbíthető.

39. táblázat – A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet pozíciószintű módosítása

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | PUTI1 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>PUTI1</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 5 | Cleared | true | |
| 98 | Action type | MODI | |
| 99 | Level | PSTN | |

5.2.1.6 Az értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszintű helyesbítése

201. A 40. táblázat az adatszolgáltatási mezők olyan esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor egy értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó előző adatszolgáltatásban tévesen beküldött adatmezők ügyletszintű helyesbítésére kerül sor.

40. táblázat – Az értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszintű helyesbítése

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|--|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI1 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> </pre> |
| 98 | Action type | CORR | |
| 99 | Level | TCTN | |

40. táblázat – Az értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszintű helyesbítése

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.2.1.7 A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet pozíciószintű helyesbítése

202. A 41. táblázat az adatszolgáltatási mezők olyan esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor valamely központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó előző adatszolgáltatásban tévesen beküldött adatmezők pozíciószintű helyesbítésére kerül sor. Nem szükséges helyesbíteni az eredeti ügyletszintű adatszolgáltatást, ha azt helyesen jelentették.

41. táblázat – A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet pozíciószintű helyesbítése

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|--|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | PUTI1 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> </LnData> </RpTrad> </pre> |
| 5 | Cleared | true | |
| 98 | Action type | CORR | |
| 99 | Level | PSTN | <pre> <UnqTradldr>PUTI1</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> </pre> |

41. táblázat – A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet pozíciószintű helyesbítése

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.2.1.8 Az értékpapír-finanszírozási ügylet értékelése (csak értékpapírok kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele esetén)

203. A 42. táblázat az adatszolgáltatási mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor aktualizálják az értékpapír-kölcsönzési ügylet tárgyát képező értékpapírok értékelését. A szerződő fél 1 000 000 EUR értékűre értékeli a kölcsönbe adott értékpapírokat, amely ebben az esetben egybeesik a hitelértékkel (2.56. mező), amely nem vonatkozik a „VALU” intézkedéstípusra. Ebben az esetben a szerződő fél a hitel pénznemében szolgáltat adatot a kölcsönbe adott értékpapírok értékeléséről (2.57. mező). A piaci érték pénzneme az XML-címkében szerepel.

42. táblázat – Az értékpapír-finanszírozási ügylet értékelése (csak értékpapírok kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele esetén)

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|--|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI1 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <ValtnUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MktVal Ccy="EUR">1000000</MktVal> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </ValtnUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 57 | Market value | 1000000 | |
| 98 | Action type | VALU | |

5.2.1.9 A biztosítékok aktualizálására vonatkozó adatszolgáltatás ügyletszinten biztosítékkal fedezett értékpapír-finanszírozási ügylet esetében

204. A biztosítékkal kapcsolatos bármilyen információval kapcsolatos adatszolgáltatás csak COLU intézkedéstípusként történhet, és az ügyletszinten biztosítékkal fedezett értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a biztosítékkal fedezett ügylet egyedi ügyletazonosítójáról is adatot kell szolgáltatni, ahogy azt a 43. táblázat is mutatja. A biztosítékkal kapcsolatos adatszolgáltatás sajátosságait az 5.4. szakasz tárgyalja.
205. Ez a példa a pozíciószinten jelentett értékpapír-finanszírozási ügyletek biztosítékáról való adatszolgáltatásra is alkalmazható abban az esetben, ha a biztosíték a pozícióhoz van rendelve.

| 43. táblázat – A biztosítékok aktualizálására vonatkozó adatszolgáltatás az ügyletszinten biztosítékkal fedezett értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében | | | |
|--|-------------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UT11 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 98 | Action type | COLU | |
| 99 | Level | | |

206. Ezen túlmenően, ha egy értékpapír-finanszírozási ügyletet belefoglalnak egy pozícióba, akkor a biztosíték minden aktualizálásáról az adott pozícióra nézve kell adatot szolgáltatni az eredeti értékpapír-finanszírozási ügylet helyett.

5.2.1.10 A biztosítékok aktualizálására vonatkozó adatszolgáltatás a nettó kitettség szinten biztosítékkal fedezett értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében

207. A biztosítékkal kapcsolatos bármilyen információ jelentése csak COLU intézkedéstípusként történhet, és nettó kitettség szinten biztosítékkal fedezett értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében nincs szükség egyedi ügyletazonosítóra, ahogy azt a 44. táblázat is mutatja. A biztosítékkal kapcsolatos adatszolgáltatás sajátosságait az 5.4. szakasz tárgyalja.

44. táblázat – A biztosítékok aktualizálására vonatkozó adatszolgáltatás a nettó kitettség szinten biztosítékkal fedezett értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | | <pre>< SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </CollUpd> </TradData> ... </SctiesFincgRptgTxRpt></pre> |
| 98 | Action type | COLU | |
| 99 | Level | | |

5.2.1.11 Az értékpapír-finanszírozási ügylet idő előtti lezárása

208. A 45. táblázat az adatszolgáltatási mezők olyan esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor egy nyílt lejáratú értékpapír-finanszírozási ügylet lezárására vagy egy határozott lejáratú értékpapír-finanszírozási ügylet idő előtti lezárására kerül sor. Ebben a felhasználási esetben nincs jelentősége, hogy milyen szinten – azaz ügylet- vagy pozíciószinten – szolgáltatnak adatot az értékpapír-finanszírozási ügyletről, mivel a 2.99. „Szint” mező nem alkalmazható erre az intézkedéstípusra.

45. táblázat – Az értékpapír-finanszírozási ügylet idő előtti lezárása

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI1 | <pre><SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <EarlyTermntn> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </EarlyTermntn> </Rpt> </TradData></pre> |
| 98 | Action type | ETRM | |
| 99 | Level | | |

45. táblázat – Az értékpapír-finanszírozási ügylet idő előtti lezárása

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|-------------------------|
| | | | </SctiesFincgRptgTxRpt> |

5.2.1.12 Az értékpapír-finanszírozási ügylet hibának minősítése

209. A 46. táblázat az adatszolgáltatási mezőknek a tévesen benyújtott teljes adatszolgáltatás visszavonása esetén történő kitöltését szemlélteti, amikor az értékpapír-finanszírozási ügylet soha nem jött létre vagy arra nem vonatkoztak az értékpapír-finanszírozási ügyletekkel kapcsolatos adatszolgáltatási követelmények, de tévesen adatot szolgáltatnak az ügyletről a kereskedési adattárnak. Ebben a felhasználási esetben nincs jelentősége, hogy milyen szinten – azaz ügylet- vagy pozíciószinten – szolgáltatnak adatot az értékpapír-finanszírozási ügyletről, mivel a 2.99. „Szint” mező nem alkalmazható erre az intézkedéstípusra.

46. táblázat – Az értékpapír-finanszírozási ügylet hibának minősítése ügyletszinten

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI1 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> |
| 98 | Action type | EROR | <Rpt> <Err> |
| 99 | Level | | ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> </LnData> ... <CollData> ... </CollData> ... </Err> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |

5.3 Hiteladatok

210. A következő szakaszok a mezők egy adott – az ügyletek hitelezési oldalával kapcsolatban sajátos jellemzőkkel bíró – csoportjának kitöltését helyezik előtérbe. Ezek a mezők lehetővé teszik az adatszolgáltató szerződő felek számára, hogy közvetlenül értékeljék azokat az információkat, amelyekről az egyes konkrét adatszakaszokat illetően adott esetben adatot kell szolgáltatniuk.

211. Az ellenőrzési szabályok tartalmazzák a teljes útmutatást az alkalmazandó mezőkre vonatkozóan az értékpapír-finanszírozási ügyletek típusaiként, intézkedéstípusonként és szintenként, valamint a vonatkozó függőségeket is.

212. Az alábbi összes példa és felhasználási eset véletlenszerűen generált kódokat tartalmaz, amelyek nem tartoznak semmilyen létező értékpapírhoz vagy szervezethez.

5.3.1 Az esemény dátumának jelentése

213. A szerződő feleknek szem előtt kell tartaniuk, hogy egy adott esemény dátuma kapcsán jelentett információknak lehetővé kell tenniük a hatóságok számára, hogy világos képet kapjanak egy adott értékpapír-finanszírozási ügyletből (vagy azok halmazából) származó kitétségekről azon nap zárásakori állapot szerint, amelyre az értékpapír-finanszírozási ügylet vonatkozik. A szerződő feleknek az esemény dátumáról a 4.9.6. szakasznak megfelelően kell adatot szolgáltatniuk.

5.3.2 Elszámolt / el nem számolt értékpapír-finanszírozási ügyletről való adatszolgáltatás

5.3.2.1 Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek – nyitott ajánlat

214. Amikor egy ügyletet nyitott ajánlati modellben számolnak el, az elszámolásra az értékpapír-finanszírozási ügylet megkötésekor kerül sor.

215. A 47. táblázat a mezők fent említett helyzetben való kitöltését szemlélteti az „O” központi szerződő fél és a klíringtag ügyfél szempontjából, mivel az ebben az esetben azonos.

216. Az adatszolgáltatási mezők következő csoportja tekintetében kell adatot szolgáltatni:

- „Elszámolva” mezőbe (2.5. mező) az „igaz” érték kerül;
- „Az elszámolás időbélyegzője” mező (2.6. mező) megegyezik a 2.12. „A végrehajtás időbélyegzője” mező értékével;
- „Központi szerződő fél” mezőbe (2.7. mező) az egyéb központi szerződő fél jogalany-azonosítója kerül.

| 47. táblázat – A központi szerződő fél és a klíringtag szempontjából | | | |
|--|-----------------------------|------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 2 | Report tracking number | | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> |
| 5 | Cleared | true | <Rpt> <New> |
| 6 | Clearing timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <CtrPtyData> ... |
| 7 | CCP | {LEI} of CCP O | </CtrPtyData> ... |
| 9 | Master agreement Type | OTHR | <LnData> <RpTrad> |
| 10 | Other master agreement type | CCPClearing Conditions | <ExctnDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ExctnDtTm> |
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <ClrSts> <Clrd> <CCP> |
| | | | <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> |

47. táblázat – A központi szerződő fél és a klíringtag szempontjából

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </CCP> <ClrDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingCondition s</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.2.2 Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet novációs modellben

217. Amikor egy ügyletet novációs modellben számolnak el, az elszámolásra az értékpapír-finanszírozási ügylet megkötésének időpontját követően kerül sor.
218. A 48. és 49. táblázat a mezők „O” központi szerződő fél és klíringtag szempontjából történő kitöltését szemlélteti az „O” központi szerződő fél által novációs modellben elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet esetén.
219. E tekintetben az adatszolgáltatási mezők következő csoportja tekintetében kell adatot szolgáltatni:
- „Az adatszolgáltatás azonosító száma” mezőben (2.2. mező) az előző egyedi ügyletazonosítóval (a központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében a kétoldalú ügylet egyedi ügyletazonosítójával) kell adatot szolgáltatni, de csak a klíringtag és annak ügyfele köteles adatot szolgáltatni (@ központi szerződő fél nem);
 - „Elszámolva” mezőbe (2.5. mező) az „igaz” érték kerül;
 - „Az elszámolás időbélyegzője” mező (2.6. mező) a 2.12. „A végrehajtás időbélyegzője” mező után következik;
 - „Központi szerződő fél” mezőbe (2.7. mező) az egyéb központi szerződő fél jogalany-azonosítója kerül.

48. táblázat – Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet novációs modellben a központi szerződő fél szempontjából

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------------------------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI2 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingCondition s</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 2 | Report tracking number | | |
| 5 | Cleared | true | |
| 6 | Clearing timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | |
| 7 | CCP | {LEI} of CCP O | |
| 9 | Master agreement Type | OTHR | |
| 10 | Other master agreement type | CCPClearing Conditions | |
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T14:41:07Z | |

220. A 49. táblázat a példát a klíringtag szempontjából mutatja be. A mezőket az ügyfél szempontjából azonosan kell kitölteni.

49. táblázat – Elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet novációs modellben a klíringtag szempontjából

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------|---------------------------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI2 | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ClrDtTm> <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> </MstrAgrmtDtls>CCPClearingCondition s</OthrMstrAgrmtDtls> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 2 | Report tracking number | UTI1 | |
| 5 | Cleared | true | |
| 6 | Clearing timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | |
| 7 | CCP | {LEI} of CCP O | |
| 9 | Master agreement Type | OTHR | |
| 10 | Other master agreement type | CCPClearing Conditions | |
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T14:41:07Z | |

5.3.2.3 A központi szerződő fél által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet értékalapú teljesítési modellben

221. Amikor egy ügyletet értékalapú teljesítési modellben számolnak el, az elszámolásra az értékpapír-finanszírozási ügylet megkötése után kerül sor.
222. A 2.19. mező azt jelzi, hogy az ügyletet az értékalapú teljesítési mechanizmus alkalmazásával egyenlítették-e ki.
223. Az 50. táblázat szemlélteti a mezők kitöltését az egyéb központi szerződő fél szempontjából. E tekintetben az adatszolgáltatási mezők következő csoportjával kapcsolatban kell adatot szolgáltatni:
- „Elszámolva” mezőbe (2.5. mező) az „igaz” érték kerül;
 - „Az elszámolás időbélyegzője” mező (2.6. mező) a 2.12. „A végrehajtás időbélyegzője” mező után következik;
 - „Központi szerződő fél” mezőbe (2.7. mező) az egyéb központi szerződő fél jogalany-azonosítója kerül.

| 50. táblázat – A központi szerződő fél szempontjából | | | |
|--|-------------------------------------|------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI2 | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingCondition s</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </pre> |
| 2 | Report tracking number | | |
| 5 | Cleared | true | |
| 6 | Clearing timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | |
| 7 | CCP | {LEI} of CCP O | |
| 9 | Master agreement Type | OTHR | |
| 10 | Other master agreement type | CCPClearing Conditions | |
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T14:41:07Z | |
| 19 | Delivery by Value (“DBV”) indicator | true | |

50. táblázat – A központi szerződő fél szempontjából

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

51. táblázat – A klíringtag szempontjából

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------------|------------------------|---|
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UTI2 | |
| 2 | Report tracking number | UTI1 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04- </pre> |
| 5 | Cleared | true | |
| 6 | Clearing timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | |
| 7 | CCP | {LEI} of CCP O | |
| 9 | Master agreement Type | OTHR | |
| 10 | Other master agreement type | CCPClearing Conditions | |
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T14:41:07Z | <pre> 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP> <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ClrDtTm> </pre> |
| 19 | Delivery by Value (“DBV”) indicator | true | <pre> <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingCondition s</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </pre> |

| 51. táblázat – A klíringtag szempontjából | | | |
|---|-------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| | | | <pre> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.2.4 Nem elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet

224. „Elszámolt” mezőbe (2.5. mező) a „hamis” értékkel kerül az 52. táblázatban bemutatottak szerint. Az elszámolással kapcsolatos többi mező nem kerül kitöltésre. A végrehajtás időbélyegzője betöltődik.

| 52. táblázat – Nem elszámolt értékpapír-finanszírozási ügylet | | | |
|---|-------------------------------|----------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Unique Trade Identifier (UTI) | UT11 | |
| 2 | Report tracking number | | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> </LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UT11</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 5 | Cleared | false | |
| 6 | Clearing timestamp | | |
| 7 | CCP | | |
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T14:41:07Z | |

5.3.3 Kereskedési helyszín

225. A „Kereskedési helyszín” mezőt (2.8. mező) az értékpapír-finanszírozási ügylet megkötése jellegének megfelelően kell kitölteni. A szerződő feleknek mindig a MIC (piacazonosító kód) szegmenst kell használniuk.
226. Amennyiben egy értékpapír-finanszírozási ügyletet automatizált kereskedési rendszerekben vagy brókerpárosító platformon kötik, a platform piacazonosító kódját kell megadni. Ez a mező nem engedi a jogalany-azonosítóval való kitöltést.

5.3.4 Keretszerződés rész

5.3.4.1 Dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet a listában szereplő keretszerződéssel

227. Keretszerződés használatakor a következő mezőket kell bejelenteni:
- „A keretmegállapodás típusa” (2.9. mező);
 - „A keretmegállapodás verziója” (2.11. mező), amikor a 2.9. mezőbe a „BIAG”-tól eltérő érték kerül. „CSDA” vagy „OTHR”.
228. Ha a keretmegállapodás (kivéve a „BIAG”, „CSDA” vagy „OTHR”) nem rendelkezik verzióval, a szerződő feleknek a „Keretmegállapodás verziója” mezőben a szerződés aláírásának évét kell rögzíteniük.
229. A központi értéktár megghiúsuláskezelési programja alatt álló értékpapír-finanszírozási ügyleteket „CSDA” keretmegállapodás verzióval kell bejelenteni.
230. Az 53. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, ha az értékpapír-finanszírozási ügyletet a 2011-es GMRA alapján kötötték.

| 53. táblázat – Dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet a listában szereplő keretszerződéssel | | | |
|---|-----------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 9 | Master agreement type | GMRA | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> <Vrsn>2011</Vrsn> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> </pre> |
| 10 | Other master agreement type | | |
| 11 | Master agreement version | 2011 | |

53. táblázat – Dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet a listában szereplő keretszerződéssel

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.4.2 Dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet a listában nem szereplő keretszerződéssel

231. A listában nem szereplő keretszerződés (pl. központi szerződő fél elszámolási feltételei megújított ügyletekhez, vagy kétoldalú kiemelt ügynöki megállapodások értékpapírügyletkehez kapcsolódó hitelezésnél) használatakor a következő mezőket kell bejelenteni:

- „A keretmegállapodás típusa” (2.9. mező).
- „Egyéb keretmegállapodás-típus” (2.10. mező), amikor a 2.9. mezőben „OTHR” szerepel.

232. Az 54. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor az értékpapír-finanszírozási ügyletet a listában nem szereplő keretszerződés alapján kötötték, és hivatkozik az egyéb központi szerződő félre vonatkozó szabálykönyvre.

54. táblázat – Dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet a listában nem szereplő keretszerződéssel

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------|---------------------|--|
| 9 | Master agreement type | OTHR | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <LnData> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <RpTrad> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>CCP O Repo Rulebook</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> </pre> |
| 10 | Other master agreement type | CCP O Repo Rulebook | |
| 11 | Master agreement version | | |

54. táblázat – Dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet a listában nem szereplő keretszerződéssel

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.4.3 Nem dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet

233. Nem dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet esetén a következő mezőket kell bejelenteni (lásd 55. táblázat):

- „A keretmegállapodás típusa” (2.9. mező); amelyet „OTHR” értékkel kell kitölteni.
- „Egyéb keretmegállapodás-típus” (2.10. mező); amelyet „Nem dokumentált” értékkel kell kitölteni.

55. táblázat – Nem dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------|--------------|--|
| 9 | Master agreement type | OTHR | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>Undocumented</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> ... <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </pre> |
| 10 | Other master agreement type | Undocumented | |
| 11 | Master agreement version | | |

55. táblázat – Nem dokumentált értékpapír-finanszírozási ügylet

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|-------------------------|
| | | | </SctiesFincgRptgTxRpt> |

5.3.5 Az ügylet megkötése és kezdete

234. A következő két példa egy a) azonnal induló és egy b) határidős értéknappal induló értékpapír-finanszírozási ügyletet szemléltet.

235. Az értéknappal a kiegyenlítés megállapított időpontjaként értendő a 2.13. mező szabályozástechnikai standardban szereplő meghatározásával összhangban. A kiegyenlítés átmeneti megghiúsulása a várt értéknapon nem tesz további adatszolgáltatást (pl. „módosítást”) szükségessé, kivéve, ha a szerződő felek megállapodnak abban, hogy a kiegyenlítés megghiúsulása miatt módosítják vagy megszüntetik az ügyletet (amely esetben a módosítási vagy megszüntetési eseményről megfelelően adatot kell szolgáltatni).

5.3.5.1 Azonnali

236. Az 56. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor az ügyletet két napon belül, vagyis az uniós kiegyenlítési ciklus alatt végrehajtják és az elindul. Ez egy azonnali értékpapír-finanszírozási ügylet.

56. táblázat – Azonnali

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------|----------------------|---|
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <ExctnDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ExctnDtTm> <ValDt>2020-04-24</ValDt> </RpTrad> </LnData> ... <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |
| 13 | Value date (Start date) | 2020-04-24 | |

5.3.5.2 Határidős

237. Az 57. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor az ügylet egy hónappal a végrehajtása után indul. Ez egy határidős értékpapír-finanszírozási ügyletet jelent.

| 57. táblázat – Határidős | | | |
|--------------------------|-------------------------|----------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 12 | Execution timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <ExctnDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ExctnDtTm> <ValDt>2020-05-22</ValDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 13 | Value date (Start date) | 2020-05-22 | |

5.3.6 Az értékpapír-finanszírozási ügylet futamideje

238. A Minimális felmondási idő (2.16. mező) bejelentésekor a szerződő feleknek meg kell adniuk a munkanapokra vonatkozó információkat az értékpapír-finanszírozási ügyletet szabályozó vonatkozó keretszerződés vagy kétoldalú megállapodás munkanapra vonatkozó meghatározásának megfelelően.

239. Amikor ez a mező olyan értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozik, amelynek a választhatósága nem szerepel az adatszolgáltatásra vonatkozó technikai standardban, például visszaváltható repoügyletek esetében, a szerződő feleknek a „Visszavonhatóság legkorábbi időpontjára” (2.17. mező) vonatkozóan kell információval szolgálniuk, amennyiben az rendelkezésre áll.

240. A szerződő feleknek a nyílt végű repoügyletek tekintetében meg kell adniuk a „Minimális felmondási időt” (2.16. mező), vagyis a 2.21. mezőt „igaz” értékkel kell kitölteni, csakúgy, mint a megújuló és a meghosszabbítható repoügyletek esetében, vagyis a 2.22. mezőben az ETSB és EGRN értéket kell megadni.

241. A szerződő feleknek a 2.17. mezőben meg kell adniuk a „Visszavonhatóság legkorábbi időpontját” azon értékpapír-finanszírozási ügyletek vonatkozásában, amelyek rendelkeznek a lezárás választhatóságával. Amennyiben a szerződő felek a visszavonhatóság legkorábbi időpontját illetően nem állapodtak meg új időpontban, a visszavonhatóság eredeti legkorábbi időpontját kell megadniuk az értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozóan.

5.3.6.1 Nyílt végű

242. Az 58. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor a szerződő felek egy nyílt végű ügyletben állapodtak meg, egy napos minimális felmondási idővel.

| 58. táblázat – Nyílt végű | | | |
|---------------------------|--------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 14 | Maturity date (End date) | | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> |
| 16 | Minimum notice period | 1 | |
| 17 | Earliest call-back date | | |
| 21 | Open term | true | <CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MinNtcePrd>1</MinNtcePrd> <Term> <Opn>NOAP</Opn> </Term> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |

5.3.6.2 Fix lejáratú

243. Az 59. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor a szerződő felek az értékpapír-finanszírozási ügylet záró (határidős) szakaszára abban állapodtak meg, hogy a biztosítékot 2020. május 22-én kicserélik pénzeszközre, értékpapírra vagy áruira.

244. A példában legalább 5 munkanappal korábban kell az egyik szerződő félnek tájékoztatnia a másik szerződő felet az értékpapír-finanszírozási ügylet felmondásáról.

245. A legkorábbi dátum, amelyen a kölcsönt nyújtó jogosult visszavonni a pénzeszközök egy részét vagy felmondani az ügyletet: 2020. május 7. Bár ez a forgatókönyv nem általános gyakorlatot mutat be, de előfordulhat.

| 59. táblázat – Fix lejáratú | | | |
|-----------------------------|--------------------------|------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 14 | Maturity date (End date) | 2020-05-22 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MinNtcePrd>5</MinNtcePrd> <EarlstCallBckDt>2020-05- 07</EarlstCallBckDt> </RpTrad> </LnData> </New> <Mod> <LnData> <RpTrad> <Term> <Fxd> <MtrtyDt>2020-05- 22</MtrtyDt> </Fxd> </Term> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 16 | Minimum notice period | 5 | |
| 17 | Earliest call-back date | 2020-05-07 | |
| 21 | Open term | false | |

5.3.7 A lezárás választhatósága

246. Az ESMA rámutat arra, hogy a szerződő feleknek a 2.22. mezőt az alábbi értékek egyikével kell kitölteniük: „EGRN”, „ETSB” vagy „NOAP”. A 2.21. mezőben az alábbi értékek egyikének kell szerepelnie: „igaz” vagy hamis”. Ha a 2.22. mezőben (a lezárás választhatósága) „ETSB” értéket adtak meg, ezt a mezőt „hamis” értékkel kel kitölteni.

247. Amennyiben az értékpapír-finanszírozási ügylet visszavonható vagy visszahívható, a szerződő feleknek ezt az információt a „Visszavonhatóság legkorábbi időpontja” mezőben (2.17. mező) kell megadniuk.

5.3.8 Általános és egyedi biztosítéki szerződések

248. Az „Általános biztosítékra utaló mutató” mező (2.18. mező) csak a biztosítékként nyújtott értékpapírokra vonatkozik, nem pedig a kölcsönbe adott értékpapírokra.

249. A szabályozástechnikai standarddal összhangban és a pénzpiacokra vonatkozó statisztikai adatszolgáltatásban használt adatszolgáltatási utasításokkal való összhang érdekében „GENE” értéket kell megadni minden olyan esetben, amikor a biztosíték nyújtója az előre meghatározott kritériumoknak megfelelő értékpapírok közül kiválaszthatja azt az értékpapírt, amelyet fedezetként nyújt. Ide tartoznak többek között a valamely automatikus kereskedési rendszer, például a központi szerződő felek által üzemeltetett rendszer által biztosított általános biztosítéki eszközök, és az olyan ügyletek, amelyekben a biztosítékot háromszereplős szolgáltatást nyújtó ügynök kezeli. A legtöbb értékpapír-kölcsönzési vagy értékpapír-kölcsönvételi megállapodás esetében szintén a „GENE” értéknek kell az alapesetnek lennie. A „SPEC” értéket csak azokban az esetekben kell megadni, amikor a biztosíték elfogadója biztosítékként egy konkrét nemzetközi értékpapír-azonosító szám (ISIN) megadását kéri.

250. A biztosítékkal történő fedezés nettó kitétségre való alkalmazásával kapcsolatos adatszolgáltatás (2.73. mező) külön kérdés, amely nem kapcsolódik közvetlenül a biztosítéki megállapodás típusához. Az általános biztosítéki platformon zajló ügyletek biztosítékkal való fedezése történhet egyetlen ügylet alapján, vagy akár a nettó kitétség alapján. A szerződő feleknek ezekről megfelelően kell adatokat szolgáltatniuk. A biztosítékkosarakkal kapcsolatos adatszolgáltatást a biztosítékokról szóló 5.4.2. szakasz ismerteti.

251. Ha egy értékpapír-finanszírozási ügyletet eredetileg általános biztosítékkal fedezett ügyletként kötöttek meg, de ahhoz a végrehajtás után a biztosítékfogadó által választott egyedi értékpapírokat rendeltek, azonnal egyedi fedezettel biztosított ügyletté válik. A „MODI” intézkedéstípusként bejelentett értékpapír-finanszírozási ügyletről a 2.18. mező felülvizsgált értékével kell adatot szolgáltatni, és a vonatkozó biztosítékot „COLU” intézkedéstípusként kell bejelenteni.

252. A szerződő felek eltérő megállapodásának hiányában a háromoldalú repoügyletekről a „GENE” értékkel kitöltött 2.18. „Általános biztosítékra utaló mutató” mezőben kell adatot szolgáltatni.

253. A 60., 61. és 62. táblázat három példát mutat be az „Általános biztosítékra utaló mutató” kitöltésére (2.18. mező). Felhívjuk figyelmet, hogy ezek nem feltétlenül fedik le az összes létező esetet.

5.3.8.1 Egyedi biztosíték tulajdonjog-átruházás során

254. A 60. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, ha az értékpapír-finanszírozási ügyletre egyedi biztosítéki megállapodás vonatkozik (a 2.18. mezőben a

SPEC érték szerepel), és az ilyen biztosíték tulajdonjog-átruházás tárgyát képezi (2.20. mezőben a TTCA érték szerepel).

| 60. táblázat – Tulajdonjog-átruházás tárgyát képező egyedi biztosíték | | | |
|---|-------------------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 18 | General collateral indicator | SPEC | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>SPEC</GnlColl> <DlvryByVal>>false</DlvryByVal> </pre> |
| 19 | Delivery By Value ('DBV') indicator | false | |
| 20 | Method used to provide collateral | TTCA | |

5.3.8.2 Zálogjog tárgyát képező általános biztosíték

255. A 61. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, ha az értékpapír-finanszírozási ügyletre általános biztosítéki megállapodás vonatkozik (a 2.18. mezőben a GENE érték szerepel), és az ilyen biztosíték értékpapírokból álló pénzügyi biztosítékról szóló megállapodás hatálya alá tartozik (2.20. mezőben a SICA érték szerepel).

| 61. táblázat – Zálogjog tárgyát képező általános biztosíték | | | |
|---|-------------------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 18 | General collateral indicator | GENE | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>GENE</GnlColl> <DlvryByVal>>false</DlvryByVal> </pre> |
| 19 | Delivery By Value ('DBV') indicator | false | |
| 20 | Method used to provide collateral | SICA | |

61. táblázat – Zálogjog tárgyát képező általános biztosíték

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <CollDlvryMtd>SICA</CollDlvryMtd> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.8.3 Tulajdonjog-átruházás tárgyát képező, értékalapú teljesítésű általános biztosíték

256. A 62. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, ha az értékpapír-finanszírozási ügyletre általános biztosítéki megállapodás vonatkozik (a 2.18. mezőben a GENE érték szerepel), és az ilyen biztosíték tulajdonjog-átruházás tárgyát képezi (2.20. mezőben a TTCA érték szerepel). Az ügylet kiegyenlítése értékalapú teljesítési mechanizmussal történik (2.19. mező), IGAZ értékkel.

62. táblázat – Tulajdonjog-átruházás tárgyát képező, értékalapú teljesítésű általános biztosíték

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------------|---------|---|
| 18 | General collateral indicator | GENE | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <GnlColl>GENE</GnlColl> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 19 | Delivery By Value ('DBV') indicator | true | |
| 20 | Method used to provide collateral | TTCA | <pre> <CollDlvryMtd>TTCA</CollDlvryMtd> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.9 Fix vagy változó kamatlábak

257. Az értékpapír-finanszírozási ügyletek megkötésekor a szerződő felek megállapodhatnak abban, hogy fix kamatlábat vagy változó kamatlábat használnak az értékpapír-finanszírozási ügylet hiteloldalán. Negatív értékek megengedettek a „Fix kamatláb” (2.23.) és a „Kiigazított változó kamatláb” (2.35.) mezőnél.
258. Változó kamatlábak bejelentésekor a szerződő feleknek jelezniük kell a vonatkozó kamatlábat és az alkalmazandó felárat. A szerződő feleknek nem kell naponta aktualizálniuk ezt az információt, csak akkor, ha megállapodnak abban, hogy módosítják a kamatlábat vagy a felárat.
259. Egyes változó kamatlábakat, mint például az ESTER-t és a SOFR-t stb. az adatszolgáltatásra vonatkozó szabályozástechnikai standardok és végrehajtás-technikai standardok közzétételét követően hozták létre. Ezek ISO-kóddal rendelkeznek. A szerződő feleknek a már elfogadott kódokat kell használniuk az információk következetesebb bejelentése érdekében. Amennyiben léteznek olyan változó kamatlábak, amelyek nem rendelkeznek ISO-kóddal, a szerződő feleknek következetes alfanumerikus kódot kell megadniuk.
260. A szerződő feleknek a 2.35. „Kiigazított kamatláb” mezőt és a 2.36. „Kamatláb-időpont” mezőt illetően csak az ügylet megkötésének részeként rögzített, előre meghatározott jövőbeni kamatlábváltozások esetén kell adatot szolgáltatniuk. A fix vagy változó kamatlábak többi változását a 2.23., illetve a 2.25. mezőben kell megadni.
261. A szerződő feleknek nem kell a 2.23. vagy a 2.25. mezőben a Rövid pozíciók piaci értékéhez kapcsolódó kamatlábakat (2.71. mező) bejelenteniük.

5.3.9.1 Fix kamatláb - első adatszolgáltatás

262. Amikor a szerződő felek fix kamatlábakkal kötnek értékpapír-finanszírozási ügyletet, akkor a 2.23. és a 2.24. mezőt a 63. táblázat szerint kell kitölteniük. Ebben az esetben az Actual360 kamatnapszámítási szabállyal („A004”) számolva az évesített kamatláb „-0,23455”.

| 63. táblázat – Fix kamatláb – első adatszolgáltatás | | | |
|---|----------------------|----------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | UTI | UTI1 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <RpTrad> <IntrstRate> <Fxd> <Rate>-0.23455</Rate> </RpTrad> </LnData> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 23 | Fixed rate | -0.23455 | |
| 24 | Day count convention | A004 | |
| 98 | Action type | NEWT | |

63. táblázat – Fix kamatláb – első adatszolgáltatás

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <DayCntBsis> <Cd>A004</Cd> </DayCntBsis> </Fxd> </IntrstRate> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.9.2 Fix kamatláb – módosítás

263. Amikor a szerződő felek megállapodnak abban, hogy módosítják a fix kamatlábat, vagyis átárazzák az értékpapír-finanszírozási ügyletet, akkor a módosítást a 2.23. és a 2.24. mezőben kell bejelenteniük a 64. táblázatban bemutatottak szerint. Ebben az esetben az új Actual365Fixed kamatnapszámítási szabállyal („A005”) számolva az új évesített kamatláb „0,12345”.

64. táblázat - Fix kamatláb – módosítás

| No | Field | Example | XML Message |
|----|----------------------|---------|---|
| 1 | UTI | UTI1 | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> </LnData> <RpTrad><UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <IntrstRate> <Fxd> <Rate>0.12345</Rate> <DayCntBsis> <Cd>A005</Cd> </DayCntBsis> </Fxd> </IntrstRate> </RpTrad> </LnData> <CollData> </pre> |
| 23 | Fixed rate | 0.12345 | |
| 24 | Day count convention | A005 | |
| 98 | Action type | MODI | |

64. táblázat - Fix kamatláb – módosítás

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> ... </CollData> ... </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.9.3 Változó kamatláb – első adatszolgáltatás

264. A 65. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor a szerződő felek úgy kötöttek értékpapír-finanszírozási ügyletet, hogy referencia-kamatlábként az EONIA-t (25. mező) választották, a változó kamatláb napokban kifejezett referencia-időszaka (2.26. mező) és az egy napos időszak egész szorzója (2.27 mező) mellett.
265. A szerződő felek továbbá egy egy hetes időszakban állapodtak meg a változókamattízes gyakoriságánál (2.28. mező) az egy hetes időszak egész szorzója (2.29. mező) mellett, amely azt jelzi, hogy a szerződő felek milyen gyakran teljesítenek egymásnak kifizetéseket.
266. Ebben az esetben a változó kamatlábat napi idősakkal (2.30. mező), egy napos szorzóval (2.31. mező) fogják ismételtlen megállapítani.
267. Ebben az esetben a hitel kamatlábjának meghatározása érdekében a változó kamatlábjhoz felárként hozzáadandó (vagy levonandó, amennyiben ennél a mezőnél megengedett a negatív érték) bázispontok száma: „5” (2.32. mező).

65. táblázat – Változó kamatláb – első adatszolgáltatás

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------|---|
| 25 | Floating rate | EONA | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <IntrstRate> <Fltg> <RefRate> <Indx>EONA</Indx> </RefRate> <Term> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val> </Term> <PmtFrqcy> <Unit>WEEK</Unit> </pre> |
| 26 | Floating rate reference period - time period | DAYS | |
| 27 | Floating rate reference period - multiplier | 1 | |
| 28 | Floating rate payment frequency - time period | WEEK | |
| 29 | Floating rate payment frequency - multiplier | 1 | |
| 30 | Floating rate reset frequency - time period | DAYS | |
| 31 | Floating rate reset frequency - multiplier | 1 | |
| 32 | Spread | 5 | |

| 65. táblázat – Változó kamatláb – első adatszolgáltatás | | | |
|---|-------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| | | | <pre> <Val>1</Val> </PmtFrqcy> <RstFrqcy> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val> </RstFrqcy> <BsisPtSprd>5</BsisPtSprd> </Fltg> </IntrstRate> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.9.4 Változó kamatláb kiigazítására szolgáló mezők

268. A változó kamatláb kiigazításait a szerződő felek megállapodása szerint kell bejelenteni. Negatív értékek megengedettek.

5.3.10 A repoügyletek és a vétel-eladás/eladás-visszavásárlás ügyletek tőkeösszege

269. A 73. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, ha a tőkeösszeg az értéknapon 10 162 756,90 EUR, a lejárat napján pedig 10 161 551,48 EUR.

270. Amennyiben a lejárat napján a tőkeösszeg (2.38. mező) értéke még nem ismert, az ellenőrzési szabályok lehetővé teszik, hogy ez a mező üresen maradjon. Ezt a mezőt később aktualizálni kell, amikor az érték már ismert.

271. Referenciamutatók esetében az adatszolgáltatás napján a lejárat napján várható tőkeösszeget kell bejelenteni, és aktualizálni kell, amint az eltérés ismertté válik.

| 66. táblázat – A repoügyletek és a vétel-eladás/eladás-visszavásárlás ügyletek tőkeösszege | | | |
|--|---------------------------------------|-------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 37 | Principal amount on the value date | 10162756.90 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> </pre> |
| 38 | Principal amount on the maturity date | 10161551.48 | |
| 39 | Principal amount currency | EUR | |

66. táblázat – A repoügyletek és a vétel-eladás/eladás-visszavásárlás ügyletek tőkeösszege

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <LnData> <RpTrad> <PrncplAmt> <ValDtAmt Ccy="EUR">10162756.9</ValDtAmt> <MtrtyDtAmt Ccy="EUR">10161551.48</MtrtyDtAmt> </PrncplAmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.11 Hiteloldal értékpapír-kölcsönzésnél

272. Az értékpapír-kölcsönzési ügyleteknél az ügylet hiteloldalán olyan értékpapír van, amelyet az adatszolgáltató szerződő feleknek következetesen értékelniük kell. Az „Értékpapír vagy áru ára” mezőt (2.49. mező) abban a pénznemben kell kitölteni, amelyben az értékpapír vagy áru ára meghatározott. Ezt a pénznemet az „Ár pénzneme” mezőben kell megadni (2.50. mező). Ezenkívül az értékpapír ára nem tartalmazhat semmilyen letéti követelményt, kedvezményt, felárat, többletet stb., ezeket inkább a „Biztosíték piaci értéke mező” (2.88. mező) részeként kell bejelenteni, még akkor is, ha azokat az ügylet hiteloldalából számolják.
273. A 2.46. „Mennyiség vagy névleges összeg” mezőt illetően a névleges összeget csak kötvények esetében kell bejelenteni. A névleges összeget a „Névleges összeg pénzneme” mezőben (2.48. mező) meghatározott eredeti pénznemben kell megadni. Az egyéb értékpapírokat mennyiségként kell bejelenteni, amely esetben a „Mértékegység” mezőt (2.47. mező) kell kitölteni, míg a „Névleges összeg pénzneme” (2.48. mező) üresen marad.
274. A „Hitelértéket” abban a pénznemben kell kiszámítani, amelyben az értékpapírt az alábbi képlet szerint meghatározták, nem pedig abban a pénznemben, amelyben a két szerződő fél az ügyletet megkötötte. A „Piaci érték” azonban a kölcsönbe adott értékpapírok szerződő felek általi értékelését jelenti. Ez az értékelés a kölcsönbe adott értékpapírok denominációjától eltérő pénznemben is történhet. Lásd még az 5.2.1.8. szakaszban található példát.

275. A hitelérték kiszámítása a következőképpen történik:

Hitelérték (2.56. mező)=

Mennyiség vagy névleges összeg (2.46. mező)*Értékpapír vagy áru ára (2.49. mező)

276. Előfordulhatnak olyan esetek, amikor a kölcsönbe adott értékpapírok (vagy a biztosítékként használt értékpapírok) értékelése nem lehetséges, ami árinformáció hiányára utal. Ez az eset áll fenn például a felfüggesztett részvényeknél vagy néhány fix kamatozású értékpapírnál az illikvid piaci szegmensekben. Az ilyen értékpapírokat érintő értékpapír-finanszírozási ügyletek megkötésekor a szerződő feleknek be kell jelenteniük a szerződésben megállapított értékelést. Ha új árinformáció válik elérhetővé, mindkét szerződő félnek be kell jelentenie az értékelés aktualizálását a „Piaci érték” (2.57.) mezőben.

5.3.12 Értékpapírok

5.3.12.1 Értékpapír-minőség/A biztosíték minősége

277. Az „Értékpapír-minőség” (2.51.) és „A biztosíték minősége” (2.90.) mezőt az adatszolgáltató szervezeteknek az adatszolgáltatásra vonatkozó végrehajtás-technikai standardokban meghatározott értékek egyikével kell kitölteniük.

278. A „NOAP” értéket a következő biztosítéktípusoknál kell használni (2.94. mező): Olyan főbb tőzsdeindexben szereplő részvények (MEQU), egyéb részvények (OEQU) és egyéb eszközök (OTHR), amelyekre nem vonatkoznak az 1060/2009/EK rendelet (a hitelminősítő intézetekről szóló rendelet) értelmében vett hitelminősítések.¹⁴ A „NOTR” értéket csak olyan eszközöknél szabad használni, amelyek minősíthetők, de nem rendelkeznek hitelminősítéssel.

279. Ezen információk bejelentése, és a hitelminősítésekre való mechanikus támaszkodás elkerülése érdekében a hitelminősítő intézetekről szóló rendelet 5a. cikkével összhangban a szerződő feleknek az értékpapírok hitelminőségére vonatkozó belső értékelésükre kell támaszkodniuk, amely magában foglalhat egy vagy több hitelminősítő intézettől származó külső minősítéseket is.

280. A bejelentett értéknek a lehető legjobban kell tükröznie az értékpapír jellemzőit. Ahol külső minősítéseket használtak a 2.51. mező kitöltéséhez, a szerződő feleknek értékelésüket ideális esetben az eszköz minősítésére kell alapozniuk, nem pedig a kibocsátó minősítésére, amennyiben az rendelkezésre áll. A pénznem denominációjának (hazai vagy külföldi deviza) és a lejáratnak (rövid lejáratú vagy hosszú lejáratú) az értékpapír sajátos jellemzőit kell tükröznie.

281. A szerződő feleknek a lehető legkövetkezetesebben kell bejelenteniük az értékpapír-minőségre vonatkozó információkat, mivel azokat az egyeztetéshez fogják használni. Az

¹⁴ A hitelminősítő intézetekről szóló rendelet 3. cikke alapján a „hitelminősítés”: egy szervezet hitelképességéről, adósságról vagy pénzügyi kötelezettségről, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokról, elsőbbségi részvényekről és egyéb pénzügyi eszközökről, vagy az ilyen adósság, pénzügyi kötelezettség, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír, elsőbbségi részvény és egyéb pénzügyi eszköz kibocsátójáról kiadott vélemény, amelyet a minősítési kategóriák elfogadott és meghatározott besorolási rendszerének felhasználásával adnak ki.

ESMA figyelmét azonban felhívták azokra a lehetséges korlátozásokra, amelyek megakadályozhatják a szervezeteket abban, hogy megosszák ezt az információt. Ebben az esetben az adatszolgáltató szerződő feleknek azt az értéket kell bejelenteniük, amelyik a legjobban tükrözi belső értékelésüket.

5.3.12.2 Kötvények

282. Az árat a kötvények esetében százalékban kell megadni, de nem egy tizedes törtjeként.
283. A 67. táblázat szemlélteti a mezők kitöltését az 100 000 000 EUR névleges összegű, befektetésre ajánlott minősítésű állampapírokat érintő és hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok (kötvények) közé sorolt értékpapír-finanszírozási ügylet esetén.
284. Az értékpapírokat ebben a példában egy, a jogalany-azonosítójával azonosított (2.54. mező) német kibocsátó bocsátotta ki (2.53. mező).
285. Az értékpapír százalékban kifejezett ára 99,5 % (2.49. mező), a pénzneme euró (2.50. mező), és az értékpapír lejáratának napja 2030. április 22. (2.50. mező).
286. Az értékpapír-finanszírozási ügylet hitelértéke 99 500 000 EUR (2.56. mező), és a hitelfelvevő nem rendelkezik kizárólagos hozzáféréssel a kölcsönnyújtó értékpapír-portfóliójából történő kölcsönzéshez (2.68 mező).

| 67. táblázat – Kötvények | | | |
|--------------------------|------------------------------|---------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 40 | Type of asset | SECU | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> |
| 41 | Security identifier | {ISIN} | <Rpt> <New> |
| 42 | Classification of a security | {CFI} | ... <CtrPtyData> |
| 46 | Quantity or nominal amount | 100000000 | ... </CtrPtyData> |
| 48 | Currency of nominal amount | EUR | <LnData> <SctiesLndg> |
| 49 | Security or commodity price | 99.5 | <AsstTp> <Scty> |
| 50 | Price currency | | <Id>DE0010877643</Id> |
| 51 | Security quality | INVG | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> |
| 52 | Maturity of the security | 2030-04-22 | <NmnlVal> <Amt |
| 53 | Jurisdiction of the issuer | DE | Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> |
| 54 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> |
| 55 | Security type | GOVS | <Ptrg>99.5</Ptrg> </UnitPric> |
| 56 | Loan value | 99500000 | <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> |

| 67. táblázat – Kötvények | | | |
|--------------------------|------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 68 | Exclusive arrangements | FALSE | <pre> <Issr> <Id> <LEI> NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <ExclsvArrgmnt>>false</ExclsvArrgmnt> </Scty> </AsstTp> <LnVal Ccy="EUR">99500000</LnVal> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>DBFTFR</ </pre> |

5.3.12.3 Főbb tőzsdeindexben szereplő részvények

287. A 68. táblázat a mezők olyan részvényt érintő értékpapír-finanszírozási ügylet esetén történő kitöltését szemlélteti, amely egy főbb tőzsdeindex részét képezi, vagyis főbb tőzsdeindexben szereplő részvény (2.55. mező), és amelynek mennyisége 100 000 darab (2.46. mező). A 2.48. mező nem alkalmazható, mivel a 2.46. mezőben egy mennyiség, nem pedig a névleges összeg szerepel.
288. A szerződő feleknek a részvényeket MEQU-ként kell bejelenteniük, amennyiben azok az (EU) 2016/1646 bizottsági végrehajtási rendelet szerint ilyennek minősülnek.
289. Az eszköz típusa ismét értékpapír (2.40. mező), besorolása pedig részvény (2.42. mező). Az értékpapír-minőség nem vonatkozik az ilyen típusú értékpapírokra (2.51. mező).
290. Az értékpapírokat ebben a példában egy, a jogalany-azonosítójával azonosított (2.54. mező) német kibocsátó bocsátotta ki (2.53. mező).
291. Az értékpapír ára egységben van kifejezve, és annak értéke 9,95 EUR (2.49. mező és 2.50. mező). Mivel a mögöttes eszköz részvény, az értékpapírokhoz nem tartozik lejárat nap, ezért a 2.52. mezőt az ISO 8601 szabvány szerinti „9999-12-31” értékkel kell kitölteni.

68. táblázat – Főbb tőzsdeindexben szereplő részvények

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.12.4 Egyéb lejárat nélküli értékpapírok

293. A 69. táblázat a mezők olyan értékpapírokat érintő értékpapír-finanszírozási ügylet esetén történő kitöltését szemlélteti, amelyek nem szerepelnek a végrehajtás-technikai standardok I. mellékletének 2.55. mezőjéhez megadott listában. Ebben az esetben a 2.55. mezőt az „egyéb eszközök” értékkel kell kitölteni. Az értékpapírok mennyisége 100 000 (2.46. mező). A 2.48. mező nem alkalmazható, mivel a 2.46. mezőben egy mennyiség, nem pedig a névleges összeg szerepel.
294. Az eszköz típusa ismét értékpapír (2.40. mező), besorolása pedig ESVUFN (2.42. mező). Az értékpapír-minőség nem vonatkozik az ilyen jellegű értékpapírokra (2.51. mező).
295. Az értékpapírokat ebben a példában egy, a jogalany-azonosítójával azonosított (2.54. mező) francia kibocsátó bocsátotta ki (2.53. mező).
296. Az értékpapír ára egységben van kifejezve, és annak értéke ebben a példában 99,5 EUR (2.49. mező és 2.50. mező). Az értékpapírokhoz nem tartozik lejárat nap, ezért a 2.52. mezőt az ISO 8601 szabvány szerinti „9999-12-31” értékkel kell kitölteni.
297. Az értékpapír-finanszírozási ügylet hitelértéke 9 950 000 EUR (2.56. mező), és a hitelfelvevő nem rendelkezik kizárólagos hozzáféréssel a kölcsönnyújtó értékpapír-portfóliójából történő kölcsönbe vételhez (2.68. mező).

69. táblázat – Egyéb lejárat nélküli értékpapírok

| No | Field | Example | XML Message |
|----|------------------------------|------------|--|
| 40 | Type of asset | SECU | <SctiesFincgRptgTxRpt> |
| 41 | Security identifier | {ISIN} | <TradData> <Rpt> <New> |
| 42 | Classification of a security | {CFI} | ... |
| 46 | Quantity or nominal amount | 100000 | <CtrPtyData> ... |
| 49 | Security or commodity price | 99.5 | </CtrPtyData> <LnData> |
| 50 | Price currency | EUR | <SctiesLndg> <AsstTp> <Scty> |
| 51 | Security quality | NOAP | <Id>FR0010877000</Id> <ClssfctnTp> ESVUFN |
| 52 | Maturity of the security | 9999-12-31 | </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> |

| 70. táblázat – Árukat érintő értékpapír-finanszírozási ügyletek | | | |
|---|---------------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 40 | Type of asset | COMM | <SctiesFincgRptgTxRpt> |
| 43 | Base product | NRGY | <TradData> <Rpt> <New> |
| 44 | Sub - product | OIL | ... |
| 45 | Further sub - product | BRNT | <CtrPtyData> ... |
| 46 | Quantity or nominal amount | 100000 | </CtrPtyData> <LnData> |
| 47 | Unit of measure | BARL | <SctiesLndg> |
| 49 | Securities or commodities price | 60 | <AsstTp> <Cmmdty> <Clssfctn> <Nrgy> <Oil> |
| 50 | Price currency | USD | <BasePdct>NRGY</Base Pdct> <SubPdct>OILP</SubPdc t> <AddtlSubPdct>BRNT</A ddtlSubPdct> </Oil> </Nrgy> </Clssfctn> <Qty> <Val>100000</Val> <UnitOfMeasr>BARL</UnitO fMeasr> </Qty> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="USD">60</Amt> </MntryVal> </UnitPric> </Cmmdty> </AsstTp> <LnVal Ccy="USD">6000000</LnVal> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... |
| 56 | Loan value | 6000000 | |

70. táblázat – Árukat érintő értékpapír-finanszírozási ügyletek

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.14 Értékpapírok pénzeszköz-fedezetű kedvezményes kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele

301. A 71. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor a szerződő felek változó kedvezményes kamatlábban állapodnak meg az EONIA index (2.59. mező) alapján, a változó kedvezményes kamatláb napokban kifejezett referencia-időszaka (2.60. mező) és az egy napos időszak egész szorzója (2.61. mező) mellett.
302. A szerződő felek egy hetes gyakoriságban is megállapodtak a változó kedvezményes kamatfizetési gyakoriság tekintetében (2.62. mező) és (2.63. mező). Felhívjuk a figyelmet arra, hogy mindkét mező opcionális azon ügyletek megkönnyítése érdekében, amelyek nem határoznak meg változó kedvezményes kamatfizetési gyakoriságot.
303. A változó kamatlábat napi időszakkal (2.64. mező), egy napos szorzóval (2.65. mező) fogják ismételtlen megállapítani.
304. A hitel kamatlábjának meghatározása érdekében a változó kamatlábjhoz felárként hozzáadandó (vagy levonandó, amennyiben ennél a mezőnél megengedett a negatív érték) bázispontok száma: „5” (2.66. mező).

71. táblázat – Értékpapírok pénzeszköz-fedezetű kedvezményes kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--|---------|------------------------|
| 58 | Fixed rebate rate | | <SctiesFincgRptgTxRpt> |
| 59 | Floating rebate rate | EONA | <TradData> |
| 60 | Floating rebate rate reference period - time period | DAYS | <New> |
| 61 | Floating rebate rate reference period - multiplier | 1 | ... |
| 62 | Floating rebate rate payment frequency - time period | WEEK | <CtrPtyData> |
| 63 | Floating rebate rate payment frequency - multiplier | 1 | ... |
| | | | </CtrPtyData> |
| | | | <LnData> |
| | | | ... |
| | | | <TxLnData> |
| | | | <SctiesLndg> |
| | | | ... |
| | | | <RbtRate> |
| | | | <Fltg> |
| | | | <RefRate> |
| | | | <Indx>EONA</Indx> |

| 71. táblázat – Értékpapírok pénzeszköz-fedezetű kedvezményes kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele | | | |
|--|--|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 64 | Floating rebate rate reset frequency - time period | DAYS | </RefRate> <Term> <Unit>DAYS</Unit> |
| 65 | Floating rebate rate reset frequency - multiplier | 1 | <Val>1</Val> </Term> <PmtFrqcy> <Unit>WEEK</Unit> <Val>1</Val> </PmtFrqcy> <RstFrqcy> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val> </RstFrqcy> <BsisPtSprd>5</BsisPtSprd> </Fltg> </RbtRate> </SctiesLndg> </TxLnData> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </TradData> ... </SctiesFincgRptgTxRpt> |
| 66 | Spread of the rebate rate | 5 | |

5.3.15 Értékpapírok díjalapú kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele Értékpapírok nem pénzeszközökben nyújtott biztosítékkal fedezett kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele, értékpapírok számla-összevezetési kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele, valamint értékpapírok biztosítékeszközzel nem fedezett kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele

305. Az értékpapírok díjalapú kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele az értékpapír-kölcsönzési ügyletek három típusát foglalja magában: értékpapírok nem pénzeszközökben nyújtott biztosítékkal fedezett kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele, értékpapírok számla-összevezetési kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele, valamint értékpapírok biztosítékeszközzel nem fedezett kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele. Mindhárom típus adatszolgáltatási logikája azonos.
306. A 72. táblázat tartalmazza azt az értéket, amelyet a szerződő feleknek be kell jelenteniük a 67. „Hiteldíj” mezőben, ha nem pénzeszközökben nyújtott biztosítékkal fedezett, számla-összevezetési vagy biztosítékeszközzel nem fedezett (nem kedvezményes) értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletet kötnek. A hiteldíjat – ebben az esetben

1,23456 %-ot –, százalékjel nélkül kell megadni, amelyet xml-címkék számára kell fenntartani.

| 72. táblázat – Nem pénzeszközben nyújtott biztosíték | | | |
|--|-------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 67 | Lending fee | 1.23456 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <LndgFee>1.23456</LndgFee> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.16 Értékpapírügylethez kapcsolódó hitel összege és rövid pozíciók piaci értéke

307. Az értékpapírügylethez kapcsolódó fennálló hitel teljes összegét (2.69. mező) vagy 0 (ha az ügyfélnek teljes készpénzjávírása/hosszú készpénz-pozíciója van), vagy pozitív értéként (amikor az ügyfélnek teljes készpénzterhelése/rövid készpénz-pozíciója van a bázispénznemben) kell megadni. A bázispénznemet mindig a kiemelt bróker és az ügyfele között létrejött kétoldalú megállapodásban meghatározottak szerint kell megadni.
308. Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel teljes értékét az egyes értékpapírügylethez kapcsolódó hitel-összetevők alapján kell kiszámolni pénznemenként (2.33. és 2.34. mező). Ezeket a mezőket annyiszor kell megismételni, ahányszor az szükséges a számlán használt összes pénznem rögzítéséhez. Ez lehetővé teszi a hatóságok számára, hogy figyelemmel kísérjék az ügyfelek készpénzterhelését (vagyis az értékpapírügylethez kapcsolódó hiteleket) az egyes pénznemekben, szemben a pusztán bázispénznemben lévő nettó készpénzterheléssel, valamint a biztosítékként használt egyes pénznemekben lévő készpénzjávírással. Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel teljes összegével összhangban egy adott pénznemben a nettó ügyfélterhelést pozitív értéként kell bejelenteni a pénznemmel együtt, míg a nettó ügyféljávírást negatív értéként kell megadni.
309. A rövid pozíciók piaci értékét mindig az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel bázispénznemében denominált értékkel kell kitölteni, a kétoldalú megállapodásban meghatározottak szerint (2.70. mező). Egyedi ügyletazonosítónként egy pénzüsszeg

várható, ezért a rövid pozíciók piaci értékét nettó alapon, a nap végén kell bejelenteni. Az értékpapírügylethez kapcsolódó fennálló hitel vonatkozásában a rövid pozíciók piaci értékének fedezéséhez használt nettó készpénzjövőírásokat negatív értékként (2.33. mező) kell megadni azok pénznemével együtt (2.34. mező).

310. Ha az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel összege 0, vagyis amikor az ügyfél a bázispénznemben nettó készpénz-jövőírással rendelkezik, és a rövid pozíciók piaci értéke szintén 0, akkor a 2.33, 2.69 és a 2.71 mezők mindegyikét 0-val kell kitölteni. Egy „nulla” biztosíték aktualizálását szintén be kell jelenteni, az 5.4.4. szakaszban foglaltak szerint.

5.3.16.1 Pozitív és negatív egyenlegek egyes pénznemekben és nettó terhelés a bázispénznemben

311. A 73. táblázat az adatszolgáltatási mezőknek a bázispénznemben lévő nettó terhelés esetén történő kitöltését szemlélteti, ami ebben a konkrét példában USD-ben történő jövőírást, valamint GBP-ben és EUR-ban történő terheléseket tükröz. Az egyszerűség kedvéért ebben a példában az USD/EUR és GBP/EUR árfolyamokat egyformán 1-re állítottuk.

| 73. táblázat – Pozitív és negatív egyenlegek egyes pénznemekben és nettó terhelés a bázispénznemben | | | |
|---|--|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 33 | Margin lending currency amount | -100000 | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <MrgnLndg> <OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR">150000</OutsdngMrgnLnAmt> <ShrtMktValAmt Ccy="EUR">0</ShrtMktValAmt> <MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">- 100000</Amt> <Amt Ccy="GBP">50000</Amt> <Amt Ccy="EUR">100000</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> </pre> |
| 34 | Margin lending currency | USD | |
| 33 | Margin lending currency amount | 50000 | |
| 34 | Margin lending currency | GBP | |
| 33 | Margin lending currency amount | 150000 | |
| 34 | Margin lending currency | EUR | |
| 69 | Outstanding margin loan | 100000 | |
| 70 | Base currency of outstanding margin loan | EUR | |
| 71 | Short market value | 0 | |

73. táblázat – Pozitív és negatív egyenlegek egyes pénznemekben és nettó terhelés a bázispénznemben

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.3.16.2 Nettó jóváírás a bázispénznemben és rövid pozíciók piaci értéke

312. A 74. táblázat az adatszolgáltatási mezőknek a bázispénznemben (GBP) lévő nettó készpénzj jóváírás esetén történő kitöltését szemlélteti, ezért az értékpapírügylethez kapcsolódó fennálló hitelt 0 értékkel kell bejelenteni az ügyfél által a rövid pozíciók piaci értéke egy részének fedezéséhez biztosítékként felhasznált nem bázispénznemben (USD) lévő készpénzj jóváírással.

74. táblázat – Nettó jóváírás a bázispénznemben és rövid pozíciók piaci értéke

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--|---------|---|
| 33 | Margin lending currency amount | -100000 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <MrgnLndg> <OutsdngMrgnLnAmt Ccy="GBP">0</OutsdngMrgnLnAmt> <ShrtMktValAmt Ccy="GBP">500000</ShrtMktValAmt> <MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">- 100000</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 34 | Margin lending currency | USD | |
| 69 | Outstanding margin loan | 0 | |
| 70 | Base currency of outstanding margin loan | GBP | |
| 71 | Short market value | 500000 | |

5.3.16.3 Nettó jóváírás a bázispénznemben és nincs rövid piaci érték

313. A 75. táblázat szemlélteti az adatszolgáltatási mezők kitöltését abban az esetben, ha a készpénzjováírás bázispénznemben (EUR) történik és nincs rövid piaci érték. Mivel nincs értékpapírügylethez kapcsolódó fennálló hitel vagy rövid piaci érték, a készpénzjováírást nem kell bejelenteni (mivel nem használják biztosítékként értékpapírügylethez kapcsolódó hitelnél vagy rövid piaci értéknél). Ennek ellenére jelentést kell készíteni a hatóságok értesítése céljából a nullás egyenlegről. Az eredeti szerződésben megállapított bázispénznemet kell megadni.

| 75. táblázat – Jováírás a bázispénznemben és nincs rövid piaci érték | | | |
|--|--|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 33 | Margin lending currency amount | 0 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <MrgnLndg> <OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR">0</OutsdngMrgnLnAmt> <ShrtMktValAmt Ccy="EUR">0</ShrtMktValAmt> <MrgnLnAttr> <Amt> <Amt Ccy="USD">0</Amt> </Amt> </MrgnLnAttr> </MrgnLndg> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 34 | Margin lending currency | USD | |
| 69 | Outstanding margin loan | 0 | |
| 70 | Base currency of outstanding margin loan | EUR | |
| 71 | Short market value | 0 | |

5.4 Biztosítéki adatok

314. A következő szakaszok a mezők egy adott csoportjának kitöltését helyezik előtérbe, amelyek esetében az értékpapír-finanszírozási ügylet biztosítéka közös sajátos jellemzőkkel rendelkezik. Ez lehetővé tenné az adatszolgáltató szerződő felek számára, hogy közvetlenül értékeljék azokat az információkat, amelyeket adott esetben az egyes konkrét adatrészre vonatkozóan be kell jelenteniük.

315. Az ellenőrzési szabályok tartalmazzák az alkalmazandó mezőkre vonatkozó teljes útmutatást értékpapír-finanszírozási ügylettípusonként és a intézkedéstípusonként, valamint a vonatkozó függőségeket.

5.4.1 Értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet biztosítékeszközökkel való fedezettségére vonatkozó adatszolgáltatás

316. Attól függően, hogy az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet biztosítékeszközökkel fedezett-e vagy sem, a szerződő feleknek ezt az információt a 2.72. „Biztosítékkal nem fedezett értékpapír-kölcsönzés jelzése” mezőben kell bejelenteniük.

5.4.1.1 Biztosítékkal nem fedezett értékpapír-kölcsönzés és -kölcsönvétel

317. A szerződő feleknek „igaz” értéket kell megadniuk a 2.72. „Biztosítékkal nem fedezett értékpapír-kölcsönzés jelzése” mezőben, ha ugyan van biztosítékkal nem fedezett értékpapír-kölcsönzés, de az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletként szervezett.

5.4.1.2 Biztosítékkal fedezett értékpapír-kölcsönzés és -kölcsönvétel

318. A szerződő feleknek „hamis” értéket kell megadniuk a „Biztosítékeszközzel nem fedezett értékpapír-kölcsönzés jelzése” mezőben (2.72. mező), ha az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet biztosítékkal fedezett, vagy ha a szerződő felek megállapodnak abban, hogy az ügyletet biztosítékkal fedezik, de még nem ismert a konkrét biztosítékhalmoz.

5.4.2 Biztosítékkal való fedezettség

319. Amikor a biztosítékkosár nem ismert az adatszolgáltatás idejében, a 2.96. mezőben „NTAV” értéket kell megadni. Ugyanez vonatkozik az általános biztosítéki platformon zajló repoügyletekre. Ebben az esetben a szerződő feleknek frissíteniük kell a biztosítékkosár azonosítására vonatkozó információkat, amint azok ismertté válnak, és legkésőbb az értéknapot követő munkanapon frissíteniük kell a biztosíték-összetevőkre vonatkozó információkat.

320. Ha a biztosítékkal való fedezésre nem biztosítékkosárral szemben kerül sor, az ESMA elvárja, hogy a szerződő felek bejelentsék a vonatkozó biztosítéki elemeket.

5.4.2.1 Egyedi ügylet biztosítékkosárral

321. A 76. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, ha két különálló értékpapír-finanszírozási ügylettel kereskednek egy „GB00BH4HKS39” ISIN-kóddal azonosított biztosítékkosárral (2.96. mező) szemben. Előfordulhat, hogy több értékpapír-finanszírozási ügylettel kereskednek egy biztosítékkosárral szemben anélkül, hogy a biztosítékkal történő fedezés nettó kitettség alapján történne. Az értékpapír-finanszírozási ügyleteket ügyletszinten fedezik (a 2.73. mezőben „HIBÁS” szerepel).

76.táblázat – Egyedi ügylet biztosítékosárral

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---------------------------------------|-------------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> <OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </OthrCtrPty> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT1</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.9 | Counterparty side | GIVE | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | FALSE | |
| 96 | Collateral basket identifier | {ISIN} | |
| 98 | Action type | NEWT | |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.9 | Counterparty side | GIVE | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT2 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | FALSE | |
| 96 | Collateral basket identifier | {ISIN} | |
| 98 | Action type | NEWT | |

76.táblázat – Egyedi ügylet biztosítékosárral

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>false</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </pre> |

76. táblázat – Egyedi ügylet biztosítékosárral

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre></TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt></pre> |

5.4.2.2 Egyedi ügylet az adatszolgáltatás időpontjában nem ismert kosárazonosítóval

322. A 77. táblázat a mezők olyan egyedi ügylet esetén történő kitöltését szemlélteti, amelyet egy biztosítékosárral fedeztek, de a kosár azonosítója az adatszolgáltatás időpontjában még nem áll rendelkezésre (a 2.96. mezőben „NTAV” szerepel).

323. Az értékpapír-finanszírozási ügylet egyedi ügyletszinten fedezett (2.73. mező). Az értékpapír-finanszírozási ügylet ügyletszinten fedezett (a 2.73. mezőben „HIBÁS” szerepel).

77. táblázat – Egyedi ügylet az adatszolgáltatás időpontjában kosár nélkül

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---------------------------------------|-------------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre><SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt></pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.9 | Counterparty side | GIVE | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT11 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | FALSE | |
| 96 | Collateral basket identifier | NTAV | |
| 98 | Action type | NEWT | |

77. táblázat – Egyedi ügylet az adatszolgáltatás időpontjában kosár nélkül

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>NTAV</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.2.3 Biztosítékkal való fedezés nettó kitettségen alapon kosárral

324. A 78. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor két ügyletet egy „GB00BH4HKS39” ISIN-kóddal azonosított biztosítékosár (2.96. mező) fedez nettó kitettségen alapon (a 2.73. mezőben „IGAZ” érték szerepel). Ez a példa nem jelenti azt, hogy az összes általános biztosítékkal fedezett ügylet nettó kitettségi alapú. A szerződő feleknek úgy kell bejelenteniük az értékpapír-finanszírozási ügyleteket, ahogy azt megkötötték.
325. Érdemes megjegyezni, hogy amennyiben az értékpapír-finanszírozási ügyleteket nettó kitettségen alapon kosárral fedezik, a COLU üzeneteknek tartalmazniuk kell a biztosíték egyedi összetevőit. A kosár ISIN-kódjának bejelentése csak az értékpapírok allokációjának meghatározásáig szükséges. A biztosíték-összetevőket a nap végi állás alapján kell bejelenteni.

78. táblázat – Nettó kitettségen alapon kosárral

| No | Field | Example | XML Message |
|------|------------------------|-----------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.9 | Counterparty side | GIVE | |

| 78. táblázat – Nettó kitettség alapon kosárral | | | |
|--|---------------------------------------|-----------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender | <pre> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> </pre> |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT11 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 96 | Collateral basket identifier | {ISIN} | |
| 98 | Action type | NEWT | |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.9 | Counterparty side | GIVE | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT12 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 96 | Collateral basket identifier | {ISIN} | |
| 98 | Action type | NEWT | |

78. táblázat – Nettó kitettség alapon kosárral

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.2.4 Biztosítékkal való fedezés nettó kitettség alapon, az adatszolgáltatás időpontjában nem ismert azonosítójú kosárral

326. A 79. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor az ügylet nem fedezi biztosítékosár (2.96. mezőben „NTAV” szerepel) nettó kitettség alapon (2.73. mezőben „IGAZ” szerepel).

327. Az ügylet biztosítékkal való fedezése nettó kitettség alapon történik (2.73. mező).

| 79. táblázat – Nettó kitettségi alapon az adatszolgáltatás időpontjában kosár nélkül | | | |
|--|-----------------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 73 | Collateralisation of net exposure | true | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> </pre> |
| 96 | Collateral basket identifier | NTAV | |
| 98 | Action type | NEWT | |

5.4.3 Pénzeszközben nyújtott biztosíték

328. A 80. táblázat a mezők kedvezményes vagy számla-összevezetési értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet esetén történő kitöltését szemlélteti. A példában a biztosíték 1 000 000 euró pénzeszközben nyújtott biztosíték (2.76. és 2.77. mező). Ebben az esetben az adatszolgáltatási forgatókönyv a „NEWT” és a „COLU” intézkedéstípussal azonos.

| 80. táblázat – Pénzeszközben nyújtott biztosíték | | | |
|--|------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 76 | Cash collateral amount | 1000000 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> </pre> |

80. táblázat – Pénzeszközben nyújtott biztosíték

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------|---------|--|
| 77 | Cash collateral currency | EUR | <pre> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">1000000</Amt> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.4 Nulla biztosíték bejelentése

329. Az adatszolgáltatás egyszerűsítése érdekében, ha a biztosíték 0-val egyenlő, a biztosítékot mindig pénzeszközben nyújtott biztosítékként kell bejelenteni, ahol a pénzeszközben nyújtott biztosíték összege 0, a biztosíték-összetevő típusa pedig „CASH” függetlenül attól, hogy az adott értékpapír-finanszírozási ügylethez előzőleg használt biztosítéktípus értékpapír, áru vagy pénzeszköz volt-e.

330. A 81. táblázat szemlélteti az adatszolgáltatási mezőket abban az esetben, ha a biztosíték 0-val egyenlő, a biztosítéktípus pedig vagy értékpapír, áru (kizárólag repoügyletek és vétel-eladás/eladás-visszavásárlás ügyletek esetében) vagy pénzeszköz.

81. táblázat – Nulla biztosíték bejelentése értékpapírhoz, áruhoz vagy pénzeszközhöz

| No | Field | Example | XML Message |
|----|------------------------------|---------|---|
| 75 | Type of collateral component | CASH | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 76 | Cash collateral amount | 0 | |
| 77 | Cash collateral currency | EUR | |

81. táblázat – Nulla biztosíték bejelentése értékpapírhoz, áruhoz vagy pénzeszközhöz

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">0</Amt> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.5 Az értékpapírokból álló biztosítékra vonatkozó mezők

331. Azon értékpapírok tekintetében, amelyekre vonatkozóan nem állnak rendelkezésre adatok, kötelező az adatszolgáltatás értéknap + 1 nap értékkel. A kiegyenlítéssel kapcsolatos kérdéseket illetően olvassa el az útmutatások 5.4.8. pontját. Biztosítékkosarak esetében, ahol az adatok bejelentésére csak egyszer kerül sor az értékpapírallokációt követően, olvassa el az útmutatások 5.4.2. pontját.

5.4.5.1 Haircut

332. A szerződő feleknek a biztosítéki adatokat az adatszolgáltatásra vonatkozó szabályozástechnikai standardok mellékletében szereplő 2. táblázattal összhangban kell bejelenteniük.

333. A biztosíték piaci értékét (2.88. mező) valós értéken, haircut nélkül kell bejelenteni. Másképp fogalmazva, a biztosíték piaci értékének tartalmaznia kell a biztosíték nyújtója által elhelyezett összes biztosítékot, ideértve a függőben lévő, de még nem teljesített biztosítékot is, a haircut levonása előtt.

334. Haircut vagy letét (2.89. mező) értékét minden értékpapír-finanszírozási ügylettípus esetében ISIN-szinten, %-os értékkel kell bejelenteni. Repoügyletek esetében a haircut mértéke szerződésben megállapított, és azt az értékpapír-finanszírozási ügylet időtartamára rögzíteni kell, kivéve, ha az ügyfelek újratárgyalják a haircutot. A haircut számítása a következő: $1 - \frac{\text{pénzeszköz}}{\text{biztosíték}}$ és ezt „4,7619”-ként kell bejelenteni. Azonos elvek érvényesek a portfólió szintű repo haircut esetében (vagyis amikor a szerződő felek megállapodása alapján egységes haircutot alkalmaznak a repoügylet teljes biztosítéki portfóliójára). Az adatszolgáltatásra vonatkozó szabályozástechnikai standardokban meghatározottak szerint a portfólió szintű

haircutokat ISIN-szinten is be kell jelenteni, azaz az adatszolgáltatást meg kell ismételni a portfólióban szereplő minden egyes ISIN-kódra (és pénzeszközre, ha az a portfólió részét képezi):

335. Értékpapírok kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele esetén a „Haircut vagy letét” (2.89. mező) értéke csak a biztosítéki oldalra vonatkozó haircutokat tartalmazhatja. A letéti követelmények viszont a biztosíték piaci értékén (2.88. mező) és a pénzeszközben nyújtott biztosíték összegén (2.76. mező) keresztül kerülnek rögzítésre. Ezért a biztosíték piaci értékét és a pénzeszközben nyújtott biztosíték összegét szintén aktualizálni kell azokkal az esetleges többletekkel (például hitel-felárakkal), amelyeket az ügylet során kezdenek el alkalmazni.
336. A 82. táblázat egy olyan értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet biztosítékkal kapcsolatos adatait mutatja, ahol 100 000 euró értékű értékpapírt vettek kölcsönbe 100 000 euró pénzeszközben nyújtott biztosíték mellett (2.76. és 2.77. mező), vagyis nem alkalmaztak haircutot, ami azt jelenti, hogy a haircut bejelentendő értéke 0 (2.89 mező).

| 82. táblázat – Pénzeszközben nyújtott biztosíték haircut nélkül | | | |
|---|--------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 76 | Cash collateral amount | 100000 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">100000</Amt> </Csh> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 77 | Cash collateral currency | EUR | |
| 89 | Haircut or margin | 0 | |

337. A 83. táblázat 105 000 USD pénzeszközökkel fedezett 100 000 euró értékű értékpapírkölcsönt mutat (2.76. és 2.77. mező), a hiteloldalon egy 105 %-os letétet tükrözve.

| 83. táblázat – Pénzeszközben nyújtott biztosíték devizában, letéttel | | | |
|--|--------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 76 | Cash collateral amount | 105000 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="USD">105000</Amt> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |
| 77 | Cash collateral currency | USD | |
| 89 | Haircut or margin | 0 | |

338. A „Vegyes” biztosítékra bemutatott példában (84. táblázat), a 100 000 euró értékű, kölcsönbe adott értékpapírt 55 000 euró pénzeszközben nyújtott biztosíték (2.76. mező) és 60 000 nem pénzeszközben nyújtott biztosíték (2.88. mező) fedezi. Ez tartalmaz egy letéti követelményt (nem meghatározott) a hiteloldalon, amely a pénzeszközben és a nem pénzeszközben nyújtott biztosítékra egyaránt vonatkozik, amelyre még egy 5 %-os haircutot is alkalmaznak a biztosítékként használt értékpapírok értéke után. A 2.89. mezőt a pénzeszközben nyújtott biztosítékra vonatkozóan „0” értékkel, a biztosítékként használt értékpapírok vonatkozásában pedig „5” értékkel kell kitölteni.

| 84. táblázat – „Vegyes” biztosíték haircuttal és letéttel | | | |
|---|--------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 76 | Cash collateral amount | 55000 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> |
| 77 | Cash collateral currency | EUR | |

| 84. táblázat – „Vegyes” biztosíték haircuttal és letéttel | | | |
|---|-------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <New> ... <CtrPtyData> ... |
| 88 | Collateral market value | 60000 | </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> ... <Scty> <MktVal Ccy="EUR">60000</MktVal> |
| 89 | Haircut or margin | 5 | <HrcutOrMrgn>5</HrcutOrMrgn> </Scty> <Csh> <Amt Ccy="EUR">55000</Amt> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |

339. Negatív haircutokat be lehet jelenteni, amennyiben a biztosíték értéke kisebb a hitelértéknél. A haircut előjele nem változhat a szerződő fél minőségével.
340. A 85. táblázat olyan repoügyletet mutat be, amelyben az ügylet értékpapírosárral (ezúttal pénzeszköz nélkül) fedezett, és portfólió szintű haircut vonatkozik az biztosítékként kapott összes értékpapírra. Ugyanazt a haircutot kell bejelenteni a portfólió minden egyes biztosíték-összetevőjére (beleértve a pénzeszközöket is, ha azok a portfólió részét képezik). Egy 150 000 euró értékű hitelt két értékpapír fedezi: 110 000 euró összegben az „A” értékpapír és 50 000 euró összegben a „B” értékpapír. A biztosíték teljes piaci értéke 160 000 euró, amely a megfelel a portfólió szintjén végzett $100 * [1 - (150/160)] = 6,25\%$ haircutnak. Ez az az érték, amit be kell jelenteni a 2.89 mezőben minden egyes ISIN-kód vonatkozásában. Hasonlóan, a nettó kitettség alapon biztosítékkal való fedezés esetén (2.73. mező) ugyanazt a haircutot kell bejelenteni minden egyes értékpapír esetében.

| 85. táblázat – Biztosítékkal fedezett portfólió portfóliószintű haircuttal | | | |
|--|-------------------------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 88 | Collateral market value | 110000 | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <MktVal Ccy="EUR">110000</MktVal> </Scty> </RpTrad> <HrcutOrMrgn>6.25</HrcutOrMrgn> </Scty> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 89 | Haircut or margin | 6.25 | |
| 88 | Collateral market value | 50000 | |
| 89 | Haircut or margin | 6.25 | <pre> Ccy="EUR">50000</MktVal> <HrcutOrMrgn>6.25</HrcutOrMrgn> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

341. Olyan értékpapírügylethez kapcsolódó hitel esetében, ahol haircut vagy letéti követelmény vonatkozik a teljes biztosítékkal fedezett portfólióra, a 2.89. mezőben megadott értéket kell megadni az összes ISIN-kód és pénzeszköz tekintetében. Ha nem erről van szó, és ehelyett a haircutokat értékpapíronként alkalmazzák, akkor ISIN-specifikus haircutokat vagy letéteket kell bejelenteni (ugyanolyan formában, mint a többi értékpapír-finanszírozási ügylet esetében, azaz %-os értékkel).

5.4.5.2 Biztosíték típusa

342. A szerződő feleknek a biztosítéktípust (2.94. mező) a következő értékek egyikével kell bejelenteniük:

- a. „GOVS” – állampapírok;

- b. „SUNS” – szupranacionális és ügynökség által kibocsátott értékpapírok;
 - c. „FIDE” – bankok vagy más pénzügyi intézmények által kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok (beleértve a fedezett kötvényeket);
 - d. „NFID” – nem pénzügyi intézmények által kibocsátott, hitelviszonyt megtestesítő vállalati értékpapírok (beleértve a fedezett kötvényeket);
 - e. „SEPR” – értékpapírosított termékek (beleértve az eszközalapú értékpapírokat, a fedezett adósságkötelezvényeket, az üzleti ingatlannal fedezett értékpapírokat, a lakóingatlannal fedezett értékpapírokat, az eszközfedezetű kereskedelmi értékpapírokat);
 - f. „MEQU” – főbb tőzsdeindexben szereplő részvények (beleértve az átváltható kötvényeket);
 - g. „OEQU” – egyéb részvények (beleértve az átváltható kötvényeket);
 - h. „OTHR” – egyéb eszközök (beleértve a befektetési alapok befektetési jegyeit).
343. Egyéb értékpapírok esetében a szerződő felek más hivatalos forrásokra is támaszkodhatnak az ellentmondások és az egyeztetési problémák kockázatának minimalizálása érdekében. Az állampapírok meghatározásához az adatszolgáltató szervezeteknek referenciaként a Pénzügyi Stabilitási Tanács (FSB) értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatgyűjtésről szóló standardjainak 19. lábjegyzetét kell alkalmazniuk, és a Bázeli III szövegrészre kell támaszkodniuk. Ha az egyik szerződő felet nem érintik a Bázeli III követelmények, akkor a szerződő feleknek meg kell állapodniuk az ebben a mezőben bejelentendő értékről.
344. A „Főbb tőzsdeindexben szereplő részvények” és az „Egyéb részvények” közötti különbségtétel összhangban áll az FSB-standardjaival. Az FSB-tagok azonban eldönthetik, hogy mely indexek minősüljenek „fő indexnek”, feltéve, hogy ezeket a Pénzügyi Stabilitási Tanács/Bázeli Bankfelügyeleti Bizottság nem központilag elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekben alkalmazott haircutokra vonatkozó keretrendszerének végrehajtásával összhangban határozzák meg.
345. A tőkekövetelmény-rendelet¹⁵ alapján az ESMA fő indexekre és elismert tőzsdékre vonatkozó végrehajtás-technikai standardja tartalmazza a fő indexek felsorolását (I. melléklet, 1. és 2. táblázat). A lista tartalmazza az EU-n belüli és kívüli eszközöket lefedő részvényindexeket és átválthatókötvény-indexeket. Ezt a listát kell referenciaként használni a részvények és az átváltható kötvények „Főbb tőzsdeindex” vagy „Egyéb” kategóriába sorolásához.

5.4.5.3 A biztosíték újrafelhasználásának lehetősége

346. A szerződő feleknek a mezőt csak a biztosítékok újbóli felhasználására vonatkozó szerződéses lehetőség figyelembevételével kell kitölteniük. Ha a „Biztosíték nyújtásának módja” mezőben (2.20. mező) „TTCA” vagy „SIUR” értéket adnak meg, akkor „A biztosíték újrafelhasználásának lehetősége” mezőben (2.95. mező) mindig „IGAZ” értéket kell feltüntetni. Itt nem kell figyelembe venni azokat a működési korlátozásokat vagy

¹⁵ A Bizottság (EU) 2016/1646 végrehajtási rendelete (2016. szeptember 13.).

szabályozási követelményeket, amelyek megakadályozhatják az újrafelhasználást. Az újrafelhasználására vonatkozó szerződéses lehetőséget abban a keretmegállapodásban kell kikötni, amely meghatározza az értékpapír-finanszírozási ügyletben alkalmazott biztosítéki megállapodás típusát.

347. Például, annak a központi szerződő félnek, aki az értékpapír-finanszírozási ügylet biztosítékát egyik klíringtagról a másikra helyezi át „TTCA” keretében, azt kell bejelentenie, hogy a biztosíték újrafelhasználható, még akkor is, ha ezt a központi szerződő fél elszámolási feltételei nem teszik lehetővé. Ugyanez vonatkozik az ÁÉKBV-re: a kapott, újrafelhasználható, nem pénzeszközben nyújtott biztosítékot ilyenként kell bejelenteni annak ellenére, hogy azt nem lehet újra felhasználni az ESMA tőzsdén kereskedett alapokról (ETF-ek) és más ÁÉKBV-kkel kapcsolatos kérdésekről szóló iránymutatásai alapján.
348. Végezetül, figyelembe kell venni, hogy „A biztosíték újrafelhasználásának lehetősége” nem veszi figyelembe azt, hogy a biztosítékot újra felhasználták-e vagy újra fel fogják-e használni. Csak a biztosíték újbóli felhasználása esetén – ami magában foglalja a kölcsönbe vett értékpapíroknak az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi megállapodások keretében történő felhasználását – kell kiegészítésként újrafelhasználási jelentést küldeni (lásd az 5.6.1. szakaszt).

5.4.5.4 Hagyományos kötvények

349. A 86. táblázat a biztosítékként használt hagyományos kötvények 2020. április 24-i bejelentését szemlélteti.
350. Ebben az esetben egy repoügylet keretében 102 000 000 euró összegű, a német állam által kibocsátott, „DE0010877643” ISIN-kóddal azonosított és „DBFTFR” besorolású hitelviszonyt megtestesítő értékpapírokat – 2 %-os haircuttal és 2030. április 22-i lejárattal – használtak biztosítékként. Az értékpapírok ismertek és bejelentésre kerülnek az adatszolgáltatási határidőig a hiteloldalon szereplő többi információval együtt. Az értékpapírok minősége befektetésre ajánlott – „INVG”, és lehetőség van a biztosíték későbbi újrafelhasználására. A táblázat kizárólag a biztosítékok bejelentése szempontjából releváns mezőkre összpontosít.
351. A biztosíték névleges összegének pénzneme, illetve a mennyiség opcionális, azonban be kell jelenteni, ha névleges összegről szolgáltatnak adatot. Azokban az esetekben, amikor egy mennyiséget bejelentenek (pl. részvény), ezt a mezőt nem kell kitölteni.
352. A biztosíték értéknapját illetően ez a mező csak az előre kifizetett biztosíték összefüggésében vonatkozik az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletre.
353. Az „Egységár” (2.87. mező) meghatározása értelmében a bejelentett értéknek tartalmaznia kell a kamatozó értékpapírok felhalmozott kamatát, vagyis a „piszkos árat” (bruttó ár).

| 86. táblázat – Hagyományos kötvények | | | |
|--------------------------------------|---|---------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 3 | Event date | 2020-04-24 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | <Rpt> <New> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <CtrPtyData> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | </CtrPtyData> <LnData> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 100000000 | <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | </LnData> <CollData> |
| 86 | Price currency | | <RpTrad> <AsstTp> |
| 87 | Price per unit | 102 | <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 88 | Collateral market value | 102000000 | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <NmnlVal> |
| 89 | Haircut or margin | 2 | <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> |
| 91 | Maturity date of the security | 2030-04-22 | <UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | </UnitPric> <MktVal |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | Ccy="EUR">102000000</MktVal> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> |
| 95 | Availability for collateral reuse | true | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |
| 98 | Action type | NEWT | <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> |

| 86. táblázat – Hagyományos kötvények | | | |
|--------------------------------------|-------|---------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| | | | </RpTrad> </CollData> </New> ... </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |

5.4.5.5 Lejárat nélküli kötvények

354. A 87. táblázat egy 102 000 000 euró összegű, biztosítékként használt spanyol állami, lejárat nélküli kötvény bejelentését szemlélteti. 2 %-os haircutot alkalmaznak. Az értékpapírok ismertek és bejelentésre kerülnek az adatszolgáltatási határidőig a hiteloldalon szereplő többi információval együtt. Az értékpapírok minősége befektetésre ajánlott – „INVG”, és lehetőség van a biztosíték újrafelhasználására. A táblázat kizárólag a biztosítékok bejelentése szempontjából releváns mezőkre összpontosít.
355. A biztosíték névleges összegének pénzneme, illetve a mennyiség opcionális, azonban be kell jelenteni, ha névleges összegről szolgáltatnak adatot. Azokban az esetekben, amikor egy mennyiséget bejelentenek (pl. részvény), ezt a mezőt nem kell kitölteni.
356. A biztosíték értéknapját illetően ez a mező csak az előre kifizetett biztosíték összefüggésében vonatkozik az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletre.
357. Az „Egységár” (2.87. mező) meghatározása értelmében a bejelentett értéknek tartalmaznia kell a kamatozó értékpapírok felhalmozott kamatát, vagyis a „piszkos árat” (bruttó ár).

| 87. táblázat – Lejárat nélküli kötvények | | | |
|--|---|------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 3 | Event date | 2020-04-24 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 100000000 | |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | |
| 86 | Price currency | | |

| 87. táblázat – Lejárat nélküli kötvények | | | |
|--|-----------------------------------|---------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 87 | Price per unit | 102 | <Scty> <Id>ES0010877643</Id> |
| 88 | Collateral market value | 102000000 | <ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp> |
| 89 | Haircut or margin | 2 | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 90 | Collateral quality | INVG | Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> |
| 91 | Maturity date of the security | 9999-12-31 | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | ES | <Ptrg>102</Ptrg> </UnitPric> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> |
| 95 | Availability for collateral reuse | true | <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id> |
| 98 | Action type | NEWT | <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE </LEI> </Id> <JursdctnCtry>ES</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> |

5.4.5.6 Főbb tőzsdeindexben szereplő részvények

358. A 88. táblázat a biztosítékként használt főbb tőzsdeindexben szereplő részvények bejelentését („MEQU”) szemlélteti: ebben az esetben 105 000 000 euró összegű, francia CAC40 részvények, ESVUFN CFI-kóddal, 5 %-os haircuttal. Az értékpapírok ismertek és bejelentésre kerülnek az adatszolgáltatási határidőig a hiteloldalon szereplő többi

információval együtt. „A biztosíték minősége” mezőben „NOAP” érték szerepel, mivel a minősítés nem alkalmazandó ezekre az értékpapírokra. Lehetőség van későbbi újrafelhasználásukra.

359. A biztosíték névleges összegének pénzneme, illetve a mennyiség opcionális, azonban be kell jelenteni, ha névleges összegről szolgáltatnak adatot. Azokban az esetekben, amikor egy mennyiséget bejelentenek (pl. részvény), ezt a mezőt nem kell kitölteni.
360. A biztosíték értéknapját illetően ez a mező csak az előre kifizetett biztosíték összefüggésében vonatkozik az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletre.
361. Az „Egységár” (2.87. mező) meghatározása értelmében a bejelentett értéknek tartalmaznia kell a kamatozó értékpapírok felhalmozott kamatát, vagyis a „piszkos árat” (bruttó ár).

| 88.táblázat – Főbb tőzsdeindexben szereplő részvények | | | |
|---|---|---------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 3 | Event date | 2020-04-24 | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id> FR0000120271</Id> <ClssfctnTp> ESUVFN </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <Qty>100000000</Qty> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">10.5</Amt> </MntryVal> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">105000000</MktVal> </MktVal> </RpTrad> </CollData> </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 10000000 | |
| 86 | Price currency | EUR | |
| 87 | Price per unit | 10.5 | |
| 88 | Collateral market value | 105000000 | |
| 89 | Haircut or margin | 5 | |
| 90 | Collateral quality | NOAP | |
| 91 | Maturity date of the security | 9999-12-31 | |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | |
| 94 | Collateral type | MEQU | |
| 95 | Availability for collateral reuse | true | |

88.táblázat – Főbb tőzsdeindexben szereplő részvények

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------|---------|--|
| 98 | Action type | NEWT | <pre> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>529900S21EQ1BO4ESM68</LEI> </Id> <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.6 Változó letét nyújtása ügyletszinten nem központilag elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletek esetében

362. Az ebben az alszakaszban az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi vagy repoügyletekre tett hivatkozások pusztán példaként szolgálnak különféle keretmegállapodásokkal. Az értékpapír-finanszírozási ügyletek más típusait azonban, például az vétel-eladás/eladás-visszavásárlás ügyleteket vagy az árukat érintő értékpapír-finanszírozási ügyleteket ugyanazon elvek alapján kell bejelenteni.
363. Ezenkívül az ebben az alszakaszban szereplő példák a változó letét egyes értékpapír-finanszírozási ügyletek szintjén történő nyújtására vonatkoznak. A következő szakaszban szereplő példák viszont a változó letét nettó kitettség alapon történő, biztosítékkal való fedezés melletti nyújtásának bejelentését mutatják be.
364. A változó letét nettó kitettség alapon történő nyújtásának részét képező biztosíték-összetevők negatív előjelei a nap végi állapotot jelzik, nem pedig az adott nap folyamát. Bár ezek numerikusan egybeeshetnek, a különbség alapvető. Ezért a szerződő feleknek a nap végén megfelelően be kell jelenteniük az egyes biztosíték-összetevők állapotát. További útmutatás a 373. bekezdésben olvasható.
365. Az egyszerűség kedvéért az alábbi példákban a haircut bejelentett mértéke 0. A szerződő feleknek az 5.4.5.1. pontnak megfelelően kiszámított haircutot kell bejelenteniük.

5.4.6.1 Változó letét nyújtása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó általi kiegészítő biztosítása mellett

366. A 89. táblázat a változó letét aktualizálását szemlélteti értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet esetén a 86. táblázatban szereplő hagyományos kötvény példájához: a nyújtott biztosíték névleges összegének 1 000 099 értékű növekedése a kötvény árának 102-ről 100,99-re történő csökkenésének ellensúlyozására, a biztosítéknyújtó által szolgáltatott adatok szerint. Mind a biztosítéknyújtónak, mind a biztosítékfogadónak pontosan ugyanúgy, a 89. táblázatban részletezetteknek megfelelően kell bejelentenie a biztosítékkal kapcsolatos információkat.

| 89. táblázat – A változó letét aktualizálása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél | | | |
|---|---|-----------------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> </LnData> <SctiesLndg> <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </SctiesLndg> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of the agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMSLA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | FALSE | |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 101000099 | |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | |
| 86 | Price currency | | |
| 87 | Price per unit | 100.99 | |
| 88 | Collateral market value | 102000000 | |

89. táblázat – A változó letét aktualizálása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|---------------------|---|
| 89 | Haircut or margin | 0 | </Tp> </MstrAgrmt> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </SctiesLndg> </LnData> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <CollData> <SctiesLndg> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <Collsd> <AsstTp> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">101000099</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> |
| 98 | Action type | COLU | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> |

89. táblázat – A változó letét aktualizálása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.6.2 Változó letét nyújtása repoügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó általi kiegészítő biztosítása mellett

367. A 90. táblázat a változó letét aktualizálását szemlélteti repoügylet esetén a 86. táblázatban szereplő hagyományos kötvény példájához: a nyújtott biztosíték névleges összegének 1 000 099 értékű növekedése a kötvény árának 102-ről 100,99-re történő csökkenésének ellensúlyozására, a biztosítéknyújtó által szolgáltatott adatok szerint. Mind a biztosítéknyújtónak, mind a biztosítékfogadónak pontosan ugyanúgy, a 90. táblázatban részletezetteknek megfelelően kell bejelentenie a biztosítékkal kapcsolatos információkat.

90. táblázat – Változó letét aktualizálása repoügyletnél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-----------------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </TradData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of the agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | FALSE | |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 101000099 | |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | |

| 90. táblázat – Változó letét aktualizálása repoügyletnél | | | |
|--|-----------------------------------|---------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 86 | Price currency | | <pre> <UnqTradIdr>UT11</UnqTradIdr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> </Scty> </RpTrad> </CollData> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">101000099</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> </MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> </Issr> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </pre> |
| 87 | Price per unit | 100.99 | |
| 88 | Collateral market value | 102000000 | |
| 89 | Haircut or margin | 0 | |
| 90 | Collateral quality | INVG | |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | |
| 94 | Collateral type | GOVS | |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | |
| 98 | Action type | COLU | |

90. táblázat – Változó letét aktualizálása repoügyletnél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </RpTrad> </CollData> </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.6.3 Változó letét nyújtása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

368. A 91. táblázat a biztosíték egy másik aktualizálását szemlélteti a 86. táblázatban szereplő példához – a biztosíték névleges összegének 999 709 eurós csökkenése a kötvény árának 102-ről 103,03-ra történő emelkedésének ellensúlyozására, a biztosítéknyújtó által szolgáltatott adatok szerint. Mind a biztosítéknyújtónak, mind a biztosítékfogadónak pontosan ugyanúgy, a 91. táblázatban részletezetteknek megfelelően kell bejelentenie a biztosítékkal kapcsolatos információkat.

91. táblázat – Változó letét nyújtása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-----------------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of the agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMSLA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | FALSE | |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | |

91. táblázat – Változó letét nyújtása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---------------------------------------|---------------------|--|
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 99000291 | </CtrPtyData> </CtrPtyData> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 86 | Price currency | | <UnqTradlDr>UTI1</UnqTradlDr> |
| 87 | Price per unit | 103.03 | <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> |
| 88 | Collateral market value | 102000000 | </MstrAgrmt> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </SctiesLndg> </LnData> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <CollData> <SctiesLndg> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <Collsd> <AsstTp> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | Ccy="EUR">99000291</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg> </UnitPric> |
| 98 | Action type | COLU | <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> |

91. táblázat – Változó letét nyújtása értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.6.4 Változó letét nyújtása repoügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

369. A 92. táblázat a biztosíték egy másik aktualizálását szemlélteti a 86. táblázatban szereplő példához – a biztosíték névleges összegének 999 709 eurós csökkenése a kötvény árának 102-ről 103,03-ra történő emelkedésének ellensúlyozására, a biztosítéknyújtó által szolgáltatott adatok szerint. Mind a biztosítéknyújtónak, mind a biztosítékfogadónak pontosan ugyanúgy, a 92. táblázatban részletezetteknek megfelelően kell bejelentenie a biztosítékkal kapcsolatos információkat.

92. táblázat – Változó letét nyújtása repoügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---------------------------------------|-----------------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of the agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT11 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |

92. táblázat – Változó letét nyújtása repoügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------------------|--|
| 73 | Collateralisation of net exposure | FALSE | <Id> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 99000291 | |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | |
| 86 | Price currency | | <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <MstrAgrmt> |
| 87 | Price per unit | 103.03 | <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> |
| 88 | Collateral market value | 102000000 | </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 90 | Collateral quality | INVG | |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <Amt Ccy="EUR">99000291</Amt> </NmnlVal> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> |
| 98 | Action type | COLU | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |

92. táblázat – Változó letét nyújtása repoügyletnél az azonos értékpapírok biztosítéknyújtó számára történő visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <Jurisdiction>DE</Jurisdiction> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>false</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.7 Változó letét nyújtása nem központilag elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyleteknél nettó kitettség alapon történő, biztosítékkal való fedezés esetén

370. Nettó kitettség alapon történő, biztosítékkal való fedezés esetén az ügylet részeként kicserélt biztosítékokon túl a szerződő felek megállapodhatnak abban is, hogy nettó alapon biztosítékkal fedezik azokat a hiteleket, amelyeket az azonos típusú keretmegállapodás alapján nyújtottak.
371. Ezért vannak olyan esetek, amikor a biztosítéknyújtó által nettó alapon nyújtott egyes biztosíték-összetevőket a biztosítékfogadó visszaadhatja. Ez vagy annak biztosítását szolgálja, hogy a biztosítékkal fedezett ügyletek halmazához ne legyen túlzott biztosíték, vagy hogy a biztosíték ne haladja meg a szerződő felek által esetlegesen megállapított haircutot vagy letéti küszöböt.
372. Vannak olyan esetek is, amikor a biztosítéknyújtó által visszaadott értékpapírok nem pontosan azonosak a biztosítéknyújtó által eredetileg nyújtott értékpapírokkal. Ebben az esetben szükséges lesz meghatározni az átadás irányát, hogy helyesen lehessen kiszámolni a kitettségeket és a biztosítékkal való fedezet mértékét.
373. Ezért a biztosítékok következetes bejelentésének biztosítása érdekében, ha a biztosítékkal való fedezés nettó kitettség alapon történik:

- a. Amikor a nem központilag elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletben a változó letét nettó kitétség alapon történő nyújtásának részeként a két szerződő fél egymás között biztosítékot cserél, az XML-sémában olyan előjellel kell bejelenteniük az értékpapírok mennyiségét és azok piaci értékét, amely a saját szempontjukból tükrözi az egyes értékpapírok állapotát.
 - b. Ha a biztosítéknyújtó változó letétként plusz biztosítékot ad, akkor a biztosíték új piaci értékét nettó kitétség alapon negatív jellel kell bejelentenie.
 - c. Ha a biztosítékfogadó visszaadja ugyanazon plusz biztosíték azon részét, amelyet már változó letétként biztosítottak, akkor a biztosíték új nettó piaci értékét nettó kitétség alapon pozitív előjellel kell bejelentenie, míg a biztosítéknyújtónak negatív előjellel kell szerepeltetnie a biztosíték új nettó piaci értékét.
 - d. Ha a biztosítéknyújtó az először nyújtott biztosíték-összetevőktől eltérő biztosíték-összetevőket kap, akkor az új biztosíték-összetevők piaci értékét pozitív előjellel kell bejelentenie.
 - e. Ezzel szemben a biztosítékfogadónak pozitív előjellel kell bejelentenie a változó letét nyújtásának részeként kapott biztosíték-összetevőket, és negatív előjellel a biztosítéknyújtónak adott azon biztosíték-összetevőket, amelyek különböznek az először átvett biztosíték-összetevőktől.
374. Az adatszolgáltatásnak ez a típusa csak a COLU üzenetekre vonatkozik, amennyiben i. a biztosítékkal való fedezés nettó kitétség alapon történik, és ii. a biztosíték-összetevő(k)re nem adtak meg egyedi ügyletazonosítót. Ez az adatszolgáltatás nem vonatkozik a biztosítékok ügyletenkénti allokációjára.
375. Minden esetben, amikor a biztosítékkal való fedezés nettó kitétség alapon történik, a szerződő feleknek minden egyes, ügyletszinten fedezett értékpapír-fedezeti ügyletre vonatkozóan COLU-üzeneteket kell küldeniük, a változó letétként használt biztosítéokra vonatkozóan pedig egyetlen COLU-üzenetet.
- 5.4.7.1 Nettó kitétség – Változó letét nyújtása olyan értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet számla-összevezetésével szemben, amely ügyleti szinten pénzeszközben nyújtott biztosítékkal fedezett
376. A 93. táblázatban szereplő példában az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyleteket eredetileg pénzeszközökkel fedezték (értékpapírok pénzeszköz-fedezettű kedvezményes kölcsönbe adása és kölcsönbe vétele), és a szerződő felek változó letét nyújtását alkalmazzák egy számla-összevezetéssel szemben.
377. A pénzeszközökre rendszerint nem alkalmaznak haircutot, és ebben az esetben a letét a hiteloldalon szintén nullának tekintendő. A haircutok és a letétek vonatkozásában a szerződő felek olvassák el a 5.4.4. pont 5.4.5.1. alpontjában foglalt útmutatásokat.

93. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása olyan értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet számla-összevezetésével szemben, amely ügyleti szinten pénzeszközben nyújtott biztosítékkal fedezett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---------------------------------------|-------------------------|---|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> <SctiesLndg> <Collsd> <AsstTp> <Scty> </Scty> <Csh> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMSLA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 75 | Type of the collateral component | CASH | |
| 76 | Cash collateral amount | 100000000 | |
| 77 | Cash collateral currency | EUR | |
| 98 | Action type | COLU | |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI2 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMSLA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 75 | Type of the collateral component | CASH | |
| 76 | Cash collateral amount | 100000000 | |

93. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása olyan értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet számla-összevezetésével szemben, amely ügyleti szinten pénzeszközben nyújtott biztosítékkal fedezett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|----------------------------------|-------------------------|---|
| 77 | Cash collateral currency | EUR | </Csh> </AsstTp> |
| 98 | Action type | COLU | <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | ... </CollUpd> </Rpt> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | <RptgCtrPty> <Id> |
| 9 | Master agreement | GMSLA | <LEI>12345678901234500000</LEI> |
| 75 | Type of the collateral component | CASH | </Id> </RptgCtrPty> |
| 76 | Cash collateral amount | 5000000 | <OthrCtrPty> <Id> |
| 77 | Cash collateral currency | EUR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 98 | Action type | COLU | </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UT12</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </SctiesLndg> </LnData> <CollData> <SctiesLndg> <Collsd> |

93. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása olyan értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet számla-összevezetésével szemben, amely ügyleti szinten pénzeszközben nyújtott biztosítékkal fedezett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <AsstTp> <Scty> </Scty> <Csh> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </Csh> </AsstTp> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </SctiesLndg> </LnData> </pre> |

93. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása olyan értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylet számla-összevezetésével szemben, amely ügyleti szinten pénzeszközben nyújtott biztosítékkal fedezett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <CollData> <SctiesLndg> <Collsd> <AsstTp> <Scty> </Scty> <Csh> <Amt Ccy="EUR">5000000</Amt> </Csh> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.7.2 Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

378. A 94. táblázat három olyan egyedi ügyletazonosítóhoz tartozó biztosítékot mutat, amelyeket eredetileg ügyletenként fedeztek. E három repoügyletet azonban bevonták egy nettósítási halmazba, és a későbbi biztosítékra vonatkozó adatszolgáltatás a saját egyedi ügyletazonosítójukkal azonosított egyedi értékpapír-finanszírozási ügyletekhez kapcsolódó biztosítéki elemeket és a nettó kitettség alapon történő, biztosítékkal való fedezéshez használt biztosítékot tartalmazza.

94.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---------------------------------------|-------------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |

94.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------------------|---|
| 3 | Event date | 24/04/2020 | </Id> </RptgCtrPty> |
| 9 | Master agreement | GMRA | <OthrCtrPty> <Id> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | </OthrCtrPty> <OthrPtyData> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | </AgtLndr> </OthrPtyData> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 100000000 | </CtrPtyData> </LnData> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 86 | Price currency | | <UnqTradldr>UT1</UnqTradldr> |
| 87 | Price per unit | 100 | <MstrAgrmt> <Tp> |
| 88 | Collateral market value | 100000000 | <Tp>GMRA</Tp> </Tp> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </MstrAgrmt> </RpTrad> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </LnData> <CollData> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <RpTrad> <AsstTp> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <NmnlVal> <Amt |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <MktVal> Ccy="EUR">100000000</MktVal> |
| | | | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> |

94.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---------------------------------------|-------------------------|--|
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | <Qty>INVG</Qty> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |
| 86 | Price currency | | <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> |
| 87 | Price per unit | 100 | > </Id> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 90 | Collateral quality | INVG | |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | </Scty> <Scty> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR |
| 94 | Collateral type | GOVS | </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> |
| 98 | Action type | COLU | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI2 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id> |
| 9 | Master agreement | GMRA | <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <Tp> <Cd>GOVS</Cd> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | </Tp> |

94.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|---|
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | </Scty> </AsstTp> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 84 | Collateral unit of measure | | </RpTrad> </CollData> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | ... </CollUpd> |
| 86 | Price currency | | </Rpt> |
| 87 | Price per unit | 100 | <Rpt> <CollUpd> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <LEI>12345678901234500000</LEI> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> |
| 94 | Collateral type | GOVS | |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> |
| 98 | Action type | COLU | </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradIdr>UT12/UnqTradIdr> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT13 | </MstrAgrmt> </RpTrad> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | </LnData> <CollData> |

94.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-----------------------|---|
| 9 | Master agreement | GMRA | <RpTrad> <AsstTp> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <Scty> <Id>FR0010877643</Id> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 5000000 | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> |
| 84 | Collateral unit of measure | | </UnitPric> <MktVal |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | Ccy="EUR">50000000</MktVal> |
| 86 | Price currency | | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> |
| 87 | Price per unit | 100 | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |
| 88 | Collateral market value | 5000000 | <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </Issr> <Tp> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2040 | <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | NL | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </Scty> </AsstTp> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </RpTrad> </CollData> |
| 98 | Action type | COLU | ... |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | </CollUpd> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> |

94.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|----------------------------|--|
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | <LEI>12345678901234500000</LEI> |
| 9 | Master agreement | GMRA | </Id> </RptgCtrPty> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <OthrCtrPty> <Id> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 2000000 | </AgtLndr> </OthrPtyData> |
| 84 | Collateral unit of measure | | </CtrPtyData> </CtrPtyData> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 86 | Price currency | | <UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr> |
| 87 | Price per unit | 100 | <MstrAgrmt> <Tp> |
| 88 | Collateral market value | 2000000 | <Tp>GMRA</Tp> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </Tp> </MstrAgrmt> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </RpTrad> </LnData> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2040 | <CollData> <RpTrad> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | IT | <AsstTp> <Scty> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <Id>NL0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR |
| 94 | Collateral type | GOVS | </ClssfctnTp> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | <Amt Ccy="EUR">5000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> |

94.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------------------|--|
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">5000000</MktVal> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 2000000 | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> |
| 84 | Collateral unit of measure | | <Id> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI> |
| 86 | Price currency | | </Id> |
| 87 | Price per unit | 100 | <JurstdctnCtry>NL</JurstdctnCtry> |
| 88 | Collateral market value | 2000000 | </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </Scty> </AsstTp> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2040 | <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | ES | </RpTrad> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </CollData> |
| 94 | Collateral type | GOVS | ... </CollUpd> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 98 | Action type | COLU | <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> |

94.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>IT00BH4HKS39</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">2000000</MktVal> </RpTrad> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>IIIIIIIIIIIIIIIIIIII</LEI> </Id> </Issr> <JursdctnCtry>IT</JursdctnCtry> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> </pre> |

94.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> <Scty> <Id>ES0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>2000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE</LEI> </Id> <JursdctnCtry>ES</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.7.3 Nettó kitétség – Nem pénzeszközben nyújtott biztosítékalmazzal szemben fedezett értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletekhez kapcsolódó változó letét nyújtása, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

379. A 95. táblázat a biztosítékok összetettebb aktualizálását szemlélteti. Nincs ügyletenkénti biztosíték; az ügyletet eredetileg egy biztosítékalmaz fedezete mellett hajtották végre. Ebben a példában a kitétség biztosítékkal való fedezésére használt egyik értékpapír árának növekedését követően, vagyis miután a német államkötvény ára 102-ről 103,3-ra növekedett, a biztosítékfogadónak német államkötvényekre van szüksége, míg a biztosítéknyújtó francia államkötvényeket is elfogad. A két szerződő fél a következő helyettesítésben állapodik meg: a biztosítékfogadó 2 000 000 euró névleges összegben visszaad francia államkötvényként nyújtott biztosítékot. Így a 2 060 000 euró többlet német államkötvény piaci értékét a biztosítéknyújtó birtokában lévő 2 060 000 euró francia államkötvény piaci értéke ellensúlyozza (azaz a biztosíték elfogadójának szempontjából negatív előjellel), helyreállítva ezzel az induló nettó biztosítéki egyensúlyt.
380. Megjegyzendő, hogy a biztosítékokkal kapcsolatos adatok ismétlődő részében az értékpapírokra vonatkozó mezők kétszer ismétlődnek az összes releváns adat bejelentése érdekében. Lehetőség van mindkét értékpapír későbbi újrafelhasználására.
381. A biztosítéknyújtónak és a biztosítékfogadónak a 95. táblázatban foglaltaknak megfelelően kell bejelentenie a biztosítékra vonatkozó információkat a megfelelő előjelekkel együtt azon biztosíték-összetevők esetében, amelyek nettó kitétség alapon változó letét nyújtásának részét képezik, a 373. bekezdésben leírtaknak megfelelően.

| 95. táblázat – Nettó kitétség – Biztosítékalmazzal szemben fedezett értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletekhez kapcsolódó változó letét nyújtása, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett | | | |
|---|-----------------------------------|-----------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </OthrCtrPty> </CtrPtyData> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of the agent lender F | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMSLA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |

95. táblázat – Nettó kitétség – Biztosítékhalmozással szemben fedezett értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletekhez kapcsolódó változó letét nyújtása, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------------------|--|
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 101000000 | </AgtLndr> </OthrPtyData> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | </CtrPtyData> </CtrPtyData> |
| 86 | Price currency | | <LnData> |
| 87 | Price per unit | 103.03 | <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 88 | Collateral market value | 104060300 | <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMSLA</Tp> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </Tp> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </MstrAgrmt> </SctiesLndg> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | </LnData> <CollData> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <SctiesLndg> <Collsd> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | Ccy="EUR">101000000</Amt> </NmnlVal> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | </UnitPric> <MktVal |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | -2000000 | Ccy="EUR">104060300</MktVal> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> |
| 86 | Price currency | | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |

95. táblázat – Nettó kitettség – Biztosítékhalmozással szemben fedezett értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletekhez kapcsolódó változó letét nyújtása, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|---------------------|---|
| 87 | Price per unit | 103.015 | <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> |
| 88 | Collateral market value | -2060300 | </Id> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <Tp> <Cd>GOVS</Cd> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | </Tp> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </Scty> <Scty> <Id>FR0010877643</Id> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <ClssfctnTp>DBFTPR</ClssfctnTp> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">- 2000000</Amt> <Sgn>>true</Sgn> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.015</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">- 2060300</MktVal> |
| 98 | Action type | COLU | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF </LEI> </Id> <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |

95. táblázat – Nettó kitettség – Biztosítékhalmozással szemben fedezett értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletekhez kapcsolódó változó letét nyújtása, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </Scty> </AssfTp> <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.7.4 Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

382. A 96. táblázatban szereplő példa a 94. táblázatban bemutatott példa folytatása. Ebben az esetben sor kerül a változó letétként nyújtott egyik értékpapír visszaadására, de a változó letétként nyújtott eredeti mennyiségnél nagyobb mennyiségben.

96. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---------------------------------------|-------------------------|---|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>1234567890123450000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |

96. táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------------------|---|
| 75 | Type of the collateral component | SECU | </Id> </OthrCtrPty> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <OthrPtyData> <AgtLndr> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 100000000 | </CtrPtyData> </CtrPtyData> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 86 | Price currency | | |
| 87 | Price per unit | 100 | <UnqTradldr>UT11</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> |
| 88 | Collateral market value | 100000000 | <Tp>GMRA</Tp> </Tp> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </MstrAgrmt> </RpTrad> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </LnData> <CollData> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <RpTrad> <AsstTp> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <NmnlVal> <Amt |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | </UnitPric> <MktVal |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | Ccy="EUR">100000000</MktVal> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> |
| 86 | Price currency | | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> |
| 87 | Price per unit | 100 | <Id> |

| 96. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett | | | |
|--|---|-------------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <pre> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> > </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> > </Id> <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </pre> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | |
| 90 | Collateral quality | INVG | |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | |
| 94 | Collateral type | GOVS | |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | |
| 98 | Action type | COLU | |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI2 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | |
| 84 | Collateral unit of measure | | |

96. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|---|
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | </Scty> </AsstTp> |
| 86 | Price currency | | <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 87 | Price per unit | 100 | </RpTrad> </CollData> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | ... </CollUpd> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </Rpt> <Rpt> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <CollUpd> <CtrPtyData> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <CtrPtyData> <RptgCtrPty> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | <Id> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> |
| 94 | Collateral type | GOVS | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <Id> |
| 98 | Action type | COLU | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | </OthrCtrPty> <OthrPtyData> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | <AgtLndr> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI3 | </CtrPtyData> </CtrPtyData> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | <LnData> <RpTrad> |
| 9 | Master agreement | GMRA | <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <MstrAgrmt> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> |

96. táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|---|
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <CollData> <RpTrad> <AsstTp> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | <Scty> <Id>FR0010877643</Id> |
| 84 | Collateral unit of measure | | <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 86 | Price currency | | Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> |
| 87 | Price per unit | 100 | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | </UnitPric> <MktVal |
| 89 | Haircut or margin | 0 | Ccy="EUR">50000000</MktVal> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2040 | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | NL | <Issr> <Id> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> |
| 98 | Action type | COLU | </Tp> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | </Scty> </AsstTp> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | </RpTrad> </CollData> ... |
| 9 | Master agreement | GMRA | </CollUpd> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | </Rpt> <Rpt> <CollUpd> |

96. táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|---|
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 2000000 | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 84 | Collateral unit of measure | | |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> |
| 86 | Price currency | | </OthrCtrPty> <OthrPtyData> |
| 87 | Price per unit | 100 | <AgtLndr> |
| 88 | Collateral market value | 2000000 | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </OthrPtyData> </CtrPtyData> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </CtrPtyData> <LnData> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2040 | <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | IT | <UnqTradlDr>UTI3</UnqTradlDr> <MstrAgrmt> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <Tp> <Tp>GMRA</Tp> |
| 94 | Collateral type | GOVS | </Tp> </MstrAgrmt> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </RpTrad> </LnData> |
| 98 | Action type | COLU | <CollData> <RpTrad> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877000</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | </QtyOrNmnlVal> |

96. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>IT00BH4HKS39</Id> <ClssfctnTp> DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt> Ccy="EUR">2000000</Amt> <Sgn>true</Sgn> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal> Ccy="EUR">2000000</MktVal> </MktVal> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>IIIIIIIIIIIIIIIIIIII</LEI> </Id> </Issr> <JursdctnCtry>IT</JursdctnCtry> </Issr> </pre> |

96. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> </RptgCtrPty> </CtrPtyData> </CollUpd> </Rpt> </Rpt> </pre> |

96. táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél, egyenértékű, de nem ugyanazon értékpapírok biztosítéknyújtónak való visszaadása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>ES0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTPR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">101000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.03</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">- 2000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE </LEI> </Id> <JursdctnCtry>ES</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.7.5 Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél (97. táblázat)

383. Ez a példa a változó letét nettó kitétség alapon történő, értékpapírok melletti nyújtását illetően bemutatott előző példák egy változata. Az UTI1, UTI2 és UTI3 kódokkal azonosított három értékpapír-finanszírozási ügyletet ügyletszinten fedezik értékpapírokkal, majd változó letét nyújtásához a szerződő felek pénzeszköz biztosításában állapodtak meg. A biztosíték nyújtója az, aki pótlólagos pénzeszközt ad a kitétség fedezésére.

| 97.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél | | | |
|---|---|-------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad> </LnData> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 100000000 | |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | |
| 86 | Price currency | | |
| 87 | Price per unit | 100 | |
| 88 | Collateral market value | 100000000 | |

97.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------------------|---|
| 89 | Haircut or margin | 0 | </MstrAgrmt> </RpTrad> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </LnData> <CollData> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <RpTrad> <AsstTp> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <MktVal Ccy="EUR">100000000</MktVal> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |
| 86 | Price currency | | <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> |
| 87 | Price per unit | 100 | > </Id> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | </Issr> <Tp> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | </Scty> <Scty> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR |
| 94 | Collateral type | GOVS | </ClssfctnTp> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> |

97.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|--|
| 98 | Action type | COLU | <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | </NmnlVal> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <MktVal>50000000</MktVal> |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI2 | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | <Issr> <Id> |
| 9 | Master agreement | GMRA | <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | </Tp> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | </AsstTp> |
| 84 | Collateral unit of measure | | <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | </RpTrad> </CollData> |
| 86 | Price currency | | ... </CollUpd> |
| 87 | Price per unit | 100 | </Rpt> <Rpt> <CollUpd> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <CtrPtyData> <CtrPtyData> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <RptgCtrPty> <Id> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | <Id> |

97.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|--|
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 94 | Collateral type | GOVS | </Id> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> |
| 98 | Action type | COLU | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | </OthrPtyData> </CtrPtyData> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender B | <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradIdr>UT12</UnqTradIdr> |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UT13 | <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | </Tp> </MstrAgrmt> |
| 9 | Master agreement | GMRA | </RpTrad> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | </LnData> <CollData> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | <RpTrad> <AsstTp> <Scty> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> |
| 84 | Collateral unit of measure | | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | </UnitPric> <MktVal |
| 86 | Price currency | | Ccy="EUR">50000000</MktVal> |
| 87 | Price per unit | 100 | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <Id> |

97.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|------|-----------------------------------|-------------------------|--|
| 90 | Collateral quality | INVG | <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2040 | </Id> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | NL | <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 94 | Collateral type | MEQU | <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </Scty> |
| 98 | Action type | GOVS | </AsstTp> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | </Rpt> <Rpt> <CollUpd> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> |
| 75 | Type of the collateral component | CASH | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 76 | Cash collateral amount | 2000000 | |
| 77 | Cash collateral currency | EUR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> |
| 98 | Action type | COLU | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |

97.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <Qty>50000000</Qty> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">10</Amt> </MntryVal> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> </RpTrad> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI> </Id> <JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </pre> |

97.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">2000000</Amt> </Csh> </AsstTp> </pre> |

97.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten pénzeszközökkel fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.7.6 Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél. Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

384. A 98. táblázat részletesebben tárgyalja a 97. táblázatban szereplő példát, de ebben az esetben a bemutatott fontos elem az, hogy a nap végén nem kerül sor további biztosíték cseréjére a nettó kitettség alapon történő, biztosítékkal való fedezés változó letétjeként. Az adatszolgáltatási logika az 5.4.4. pontban szereplő nullás biztosíték bejelentéséhez hasonlít.

98.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|--|
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <pre> <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <CollUpd> ... <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> </pre> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI1 | |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |

98.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|---|---------------------|---------------------------------|
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 100000000 | </AgtLndr> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | </OthrPtyData> |
| 86 | Price currency | | </CtrPtyData> |
| 87 | Price per unit | 100 | <LnData> |
| 88 | Collateral market value | 100000000 | <RpTrad> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <MstrAgrmt> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <Tp> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <Tp>GMRA</Tp> |
| 94 | Collateral type | GOVS | </Tp> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </MstrAgrmt> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | </RpTrad> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <LnData> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <CollData> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | <RpTrad> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <AsstTp> |
| 86 | Price currency | | <Scty> |
| 87 | Price per unit | 100 | <Id>DE0010877643</Id> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <ClsfctnTp>DBFTFR</ClsfctnTp> |

98.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|---|
| 89 | Haircut or margin | 0 | <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> |
| 90 | Collateral quality | INVG | </Issr> <Tp> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </Scty> <Scty> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | </ClssfctnTp> |
| 98 | Action type | COLU | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | <MktVal>50000000</MktVal> |
| 1 | Unique Transaction Identifier ('UTI') | UTI2 | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> |
| 9 | Master agreement | GMRA | <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | </Id> |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 83 | Collateral quantity or V nominal amount | 50000000 | </Scty> </AsstTp> |
| 84 | Collateral unit of measure | | |

98.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|---|
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <pre> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </pre> |
| 86 | Price currency | | |
| 87 | Price per unit | 100 | |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | |
| 89 | Haircut or margin | 0 | |
| 90 | Collateral quality | INVG | |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2030 | |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | FR | |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | |
| 94 | Collateral type | GOVS | |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | |
| 98 | Action type | COLU | |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | |
| 1 | Unique Transaction Identifier ("UTI") | UTI3 | <pre> <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> </pre> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | |
| 9 | Master agreement | GMRA | |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | |
| 75 | Type of the collateral component | SECU | |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | |

98.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|------|---|-------------------------|---|
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 50000000 | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> |
| 84 | Collateral unit of measure | | <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> |
| 86 | Price currency | | <UnitPric> |
| 87 | Price per unit | 100 | <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> |
| 88 | Collateral market value | 50000000 | <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> |
| 89 | Haircut or margin | 0 | <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <Issr> <Id> |
| 91 | Maturity date of the security | 22/04/2040 | <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | NL | <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | </Issr> <Tp> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <Cd>GOVS</Cd> </Tp> |
| 95 | Availability for collateral reuse | TRUE | <AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> |
| 98 | Action type | COLU | </Scty> </AsstTp> |
| 1.3 | Reporting counterparty | LEI of counterparty A | <NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd> |
| 1.11 | Other counterparty | LEI of counterparty B | </RpTrad> </CollData> |
| 1.18 | Agent lender | {LEI} of agent lender F | ... </CollUpd> |
| 3 | Event date | 24/04/2020 | </Rpt> <Rpt> <CollUpd> |
| 9 | Master agreement | GMRA | <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> |
| 73 | Collateralisation of net exposure | TRUE | <Id> |

98.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|----------------------------------|---------|--|
| 75 | Type of the collateral component | CASH | <LEI>12345678901234500000</LEI> |
| 76 | Cash collateral amount | 0 | </Id> |
| 77 | Cash collateral currency | EUR | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> |
| 98 | Action type | COLU | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal> |

98.táblázat – Nettó kitétség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI> </Id> <JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr> </pre> |

98.táblázat – Nettó kitettség – Változó letét nyújtása eredetileg ügyleti szinten fedezett, majd nettósítási halmazba bevont repoügyleteknél Az adott napon a pozíció kamatmentes, és nincs szükség változó letétre.

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|---|
| | | | <pre> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Csh> <Amt Ccy="EUR">0</Amt> </Csh> </AsstTp> </RpTrad> <NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd> </RpTrad> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.8 Előre kifizetett biztosíték értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylethez

385. Nettó kitettséghez való kifejezett biztosíték-allokáció bejelentésekor a biztosíték aktualizálásánál meg kell adni a szerződő felek jogalany-azonosítóját, a keretmegállapodást, a biztosíték értéknapiját és a biztosíték konkrét allokációját, hogy a biztosíték aktualizálása összekapcsolható legyen a meglévő értékpapír-finanszírozási ügyletekkel. „A biztosíték értéknapija” mező (2.74. mező) csak értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügylettel kapcsolatban alkalmazandó.

386. Az esemény dátuma határozza meg a biztosíték kiegyenlítésének várható időpontját. A szerződő felek jogalany-azonosítójának, a keretmegállapodás és az adatmezők eredeti kereskedési adatszolgáltatás és a biztosíték aktualizálása során megadott értékeinek

összehasonlításával meghatározható, hogy mely ügyletekre vonatkozik biztosíték valamely nettó fennmaradó összeghez kapcsolódó aktualizálása. A 99. táblázatban bemutatott példában a biztosítékot az „Esemény dátuma”-ként (2.3. mező) meghatározott napon, 2020. 4. 23-án bekövetkezett várható kiegyenlítés alapján kell bejelenteni. „A biztosíték értéknapja” (2.74. mező) azt a napot határozza meg, amelytől kezdve a biztosíték aktualizálása alkalmazandó a fennálló hitelekre (azaz a biztosíték 2020.4.24-től már nem „előre kifizetett”). Ezért annak meghatározása érdekében, hogy melyik értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozik a biztosíték aktualizálása, a biztosíték értéknapját össze kell kapcsolni azon értékpapír-finanszírozási ügyletek értéknapjával és lejáratival, amelyekhez a szerződő felek azonos jogalany-azonosítója és ugyanazon keretszerződés tartozik.

| 99. táblázat – Előre kifizetett biztosíték | | | |
|--|---|---------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 3 | Event date | 2020-04-23 | <SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> |
| 74 | Value date of the collateral | 2020-04-24 | <Rpt> <CollUpd> |
| 78 | Identification of a security used as collateral | {ISIN} | <CtrPtyData> ... |
| 79 | Classification of a security used as collateral | {CFI} | </CtrPtyData> <LnData> |
| 83 | Collateral quantity or nominal amount | 100000000 | <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> </SctiesLndg> |
| 84 | Collateral unit of measure | | </LnData> <CollData> |
| 85 | Currency of collateral nominal amount | EUR | <SctiesLndg> <Collsd> |
| 86 | Price currency | | <CollValDt>2020-04-24</CollValDt> |
| 87 | Price per unit | 102 | <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id> |
| 88 | Collateral market value | 102000000 | <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> |
| 89 | Haircut or margin | 2 | <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> |
| 90 | Collateral quality | INVG | <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> |
| 91 | Maturity date of the security | 2030-04-22 | </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> |
| 92 | Jurisdiction of the issuer | DE | <Ptrg>102</Ptrg> </UnitPric> |
| 93 | LEI of the issuer | {LEI} of the issuer | <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal> |
| 94 | Collateral type | GOVS | <HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> |

99. táblázat – Előre kifizetett biztosíték

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|---------|---|
| 95 | Availability for collateral reuse | true | <pre> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id> <Jurisdiction>DE</Jurisdiction> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt> </pre> |

5.4.9 Elszámolt ügyletek portfóliója

387. A 2.97. mező (Portfólió kódja) bejelentésekor a szerződő feleknek biztosítaniuk kell, hogy adatszolgáltatásaik során következetesen használják a kódot. Ha egy kód olyan portfóliót azonosít, amely származékos ügyleteket is magában foglaló ügyleteket biztosít, a szerződő feleknek ugyanazt a kódot kell használniuk, amelyet az EMIR keretében történő adatszolgáltatáskor használtak.

388. Ezenkívül a portfólió kódja értékének nem kell egyetemesen egyedinek lennie, viszont következetesen kell használni. Mivel a 2.97. mező nem egyező értéket tartalmaz, az értéket nem kell, hogy az ügyletben szereplő mindkét szerződő fél elfogadja.

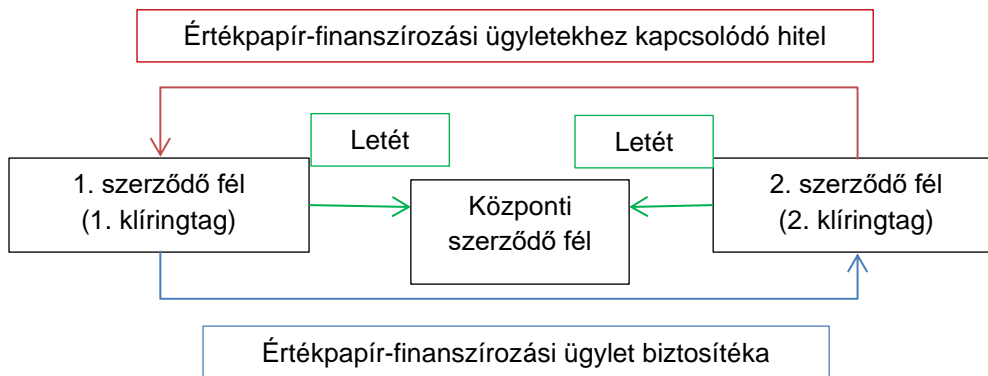
5.5 Letéti adatok

389. Az e szakaszban szereplő adatokat minden olyan szerződő félnek be kell jelentenie, akinek az értékpapír-finanszírozási ügyleteit központilag számolták el, kivéve, ha a szerződő felek a 4. cikk (2) bekezdése szerinti kötelező feladatátruházás hatálya alá tartoznak, amely esetben az abban a cikkben meghatározott szervezet lesz az adatszolgáltató szervezet.

390. Annak érdekében, hogy igénybe vehesse a központi szerződő fél szolgáltatásait, mind az 1. mind pedig a 2. klíringtag letétet helyez el a központi szerződő félnél. A letét az alapletétből és a változó letétből áll¹⁶. A klíringtagok által a központi szerződő félnél elhelyezett letét nem áll közvetlen kapcsolatban az értékpapír-finanszírozási ügylet biztosítékával. A központi szerződő fél a letétet az összes olyan ügyletből eredő kockázat fedezésére használja fel, amelyet az adott klíringtagok számára elszámol. A klíringtagok által a központi szerződő félnél elhelyezett letét az értékpapír-finanszírozási ügyletektől eltérő ügyletekből – például származtatott ügyletekből eredő kockázatok fedezésére is felhasználható.

5.5.1 A központi szerződő fél a klíringtagként részt vevő két szerződő fél között helyezkedik el

1. eset A központi szerződő fél a klíringtagként részt vevő két szerződő fél között helyezkedik el



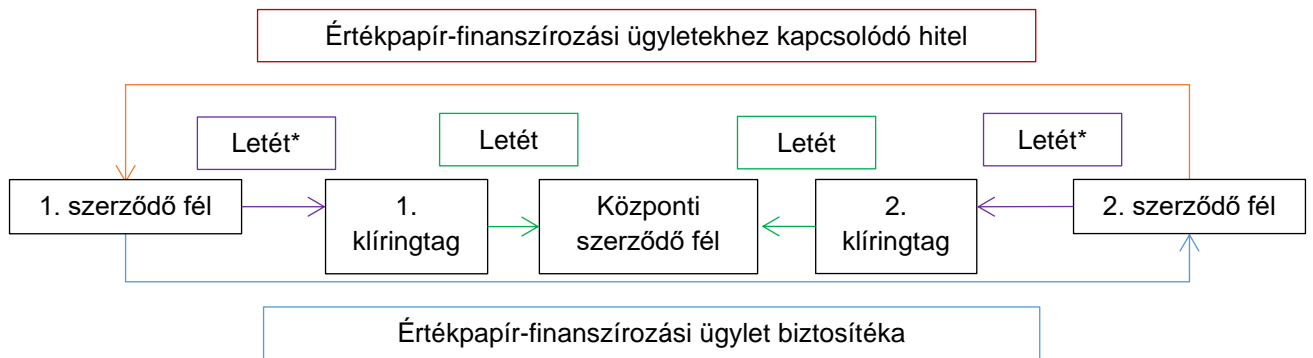
391. Amennyiben a szerződő fél önmaga nem klíringtag, az általa a klíringtagnak nyújtott letét (lásd a „letétet*” az alábbi 2. esetről) eltérhet a klíringtag által a központi szerződő félnél nyújtott letétől.

¹⁶ Előfordulhat többlet letét, amely a szükséges szintet meghaladó biztosíték része lesz.

5.5.2 A központi szerződő fél két olyan szerződő fél közé iktatja be magát, akik nem klíringtagok

-

2. eset A központi szerződő fél két olyan szerződő fél közé iktatja be magát, akik nem klíringtagok



5.5.3 A letétre vonatkozó információk bejelentése

392. Abban az esetben, ha a letétcserének egy harmadik típusa is van, a szerződő feleknek meg kell állapodniuk abban, hogy azt következetesen alapletétként vagy változó letétként jelentik-e be.
393. Az alapletét, változó letét és többletbiztosíték mindegyikét egyetlen számadat formájában kell bejelenteni, amely az összes kapott/nyújtott/záloggal terhelt eszközosztály bruttó (haircut előtti) értékét tartalmazza. Amennyiben az elszámolt portfólió nem tartalmaz származtatott ügyletet, javasolt a központi szerződő fél bázispénzemét követni, azonban ha van az EMIR alapján bejelentendő származtatott ügylet, ugyanazt a pénznemet kell használni.
394. A letéti információk csak a központi szerződő felek által elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkoznak. A 100. táblázatban bemutatott esetben a szervezet ugyanazt a portfóliót használja a biztosítékkal való fedezésre, mint az EMIR alapján. Az adatszolgáltató szerződő fél, „J” szerződő fél, aki egyben klíringtag is, a „D” szerződő fél által nyújtott átruházott adatszolgáltatási szolgáltatásokat veszi igénybe. Adatszolgáltatásában az „O” szerződő fél számára alapletétként nyújtott 1 000 000 euró összeget és a változó letétként nyújtott 300 000 euró összeget jelenti be. A szerződő fél továbbá 100 000 euró összegű többletbiztosítékot is bejelent.

| 100. táblázat – Letéti adatok | | | |
|-------------------------------|---------------------|----------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <SctiesFincgRptgTxMrgnDataRpt> <TradData> <Rpt> <TradUpd> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |

| 100. táblázat – Letéti adatok | | | |
|-------------------------------|--|-------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty D | <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> |
| 4 | Reporting Counterparty | {LEI} of counterparty J | <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty J | <CtrPty> <RptgCtrPty> |
| 6 | Other counterparty | {LEI} of CCP O | <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> |
| 7 | Portfolio code | EMIRSFTRC ODE1 | </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> |
| 8 | Initial margin posted | 1000000 | <LEI>BBBBBBBBBBB1111111111</LEI> |
| 9 | Currency of the initial margin posted | EUR | </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> |
| 10 | Variation margin posted | 300000 | <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> |
| 11 | Currency of the variation margins posted | EUR | </NttyRspnsblForRpt> <RptSubmitgNtty> |
| 12 | Initial margin received | | <LEI>11223344556677889900</LEI> |
| 13 | Currency of the initial margin received | | </RptSubmitgNtty> </CtrPty> |
| 14 | Variation margin received | | <CollPrftlId>EMIRSFTRCODE1</CollPrftlId> |
| 15 | Currency of the variation margins received | | <PstdMrgnOrColl> <InitlMrgnPstd Ccy="EUR">1000000</InitlMrgnPstd> |
| 16 | Excess collateral posted | 100000 | <VartnMrgnPstd Ccy="EUR">300000</VartnMrgnPstd> |
| 17 | Currency of the excess collateral posted | EUR | <XcssCollPstd Ccy="EUR">100000</XcssCollPstd> |
| 18 | Excess collateral received | | </PstdMrgnOrColl> <RcvdMrgnOrColl> |
| 19 | Currency of the excess collateral received | | ... </RcvdMrgnOrColl> </TradUpd> |
| 20 | Action type | MARU | </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxMrgnDataRpt> |

5.6 Adatok újrafelhasználása, pénzeszközök újrabefektetése és finanszírozási források

395. Ahogy azt a szabályozástechnikai standardok is kiemelik, az adatszolgáltatásra vonatkozó technikai standardok mellékletének 4. táblázatát alátámasztó logika eltér a

többi táblázattól, és azt nem kell egyeztetésre használni, mivel ezek az információk nem köthetők egyedi ügyletekhez. Ehelyett a nem pénzeszközben nyújtott biztosíték újrafelhasználását, a pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetését és a finanszírozási forrásokat kell az adatszolgáltató szervezet szintjén összesítve bejelenteni.

396. Ezenkívül, ha a biztosíték újrafelhasználására, a pénzeszközök újrabefektetésére vagy a finanszírozási forrásokra vonatkozó adatokat különböző időpontokban jelentik be, csak az első jelentést kell „NEWT” intézkedéstípussal bejelenteni az adatszolgáltató szerződő fél és a tájékoztatásért felelős szervezet egy adott kombinációja tekintetében, függetlenül attól, hogy az melyik mezőket tartalmazza. Az adott kombinációra vonatkozó későbbi adatszolgáltatásokat a megfelelő intézkedéstípussal kell végezni.

5.6.1 Biztosíték újrafelhasználása

397. A biztosíték újrafelhasználását az FSB-keretrendszerben ¹⁷ megállapított és a szabályozástechnikai standardokban szereplő képlet alkalmazásával kell bejelenteni. A piaci szereplők rendszerint nem tesznek különbséget saját eszközeik és a szerződő felektől kapott biztosíték között (feltéve, hogy a biztosítékul szolgáló értékpapírok újrafelhasználhatók). Ezért az FSB-képlet mögött meghúzódó szándék az, hogy a szervezetek adják meg az általuk újrafelhasznált biztosíték becsült összegét a kapott biztosíték saját eszközeikhez viszonyított aránya alapján.
398. Az adatszolgáltatási kötelezettség csak az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatzik, ami azt jelenti, hogy a más ügyletekben biztosítékul nyújtott vagy kapott értékpapírok nem tartoznak az adatszolgáltatás hatálya alá. Másképp fogalmazva, a származtatott ügyletekben vagy bármely más, az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet hatálya alá nem tartozó ügyletben letétnyújtási céllal nyújtott biztosítékot – a 4.2.1. pontban tárgyaltaknak megfelelően – nem kell szerepeltetni a képletben.
399. Ez azt is jelenti, hogy az újrafelhasználási képlet összetevőit nem kell külön bejelenteni az ESMA-nak. Ehelyett az adatszolgáltató szervezeteknek csak a képlet ISIN-szintű alkalmazásából eredő becslést kell bejelenteniük.
400. Amennyiben tényleges újrafelhasználás nem történt, az adatszolgáltatási mezőt üresen kell hagyni. Amennyiben a biztosítékot már nem használják, akkor „Újrafelhasználás aktualizálása”-ként (REUU) kell bejelenteni „0” értékkel.
401. Ha az adatszolgáltatást átruházták, az a szerződő fél, amelyikre átruházták az adatszolgáltatást, nem felelős a biztosíték becsült újrafelhasználásának bejelentéséért. A nem pénzügyi szerződő felek saját maguk felelősek a becsült újrafelhasználás kiszámolásáért és azért, hogy a becsült értéket időben megadják az adatszolgáltatásért felelős szerződő félnek.
402. Ha a szerződő felek a becsült újrafelhasználás helyett inkább a tényleges újrafelhasználást szeretnék bejelenteni, ezt is megtehetik.
403. Az FSB-keretrendszerben a „biztosíték” kifejezést gazdasági funkciója szerint tágran határozzák meg, vagyis alatta az ügylet jogi struktúrájától függetlenül értékpapírok

¹⁷ FSB Non-cash collateral re-use: Measure and metrics. <http://www.fsb.org/wp-content/uploads/Non-cash-Collateral-Re-Use-Measures-and-Metrics.pdf>

értendők. Alkalmazási körét tekintve ez azt jelenti, hogy a *kapott, újrafelhasználható biztosíték* a következőket foglalja magában:

- a. fordított repoügyletekben és vétel-eladás ügyletekben biztosítékként kapott értékpapírok;
- b. értékpapír-kölcsönvételi ügyletben kapott értékpapírok;
- c. értékpapír-kölcsönzési ügyletben biztosítékként kapott értékpapírok;
- d. kiegészítő biztosítékként kapott értékpapírok az értékpapír-finanszírozási ügyletből származó változó letéti követelmények teljesítésére.

404. Az elkülönített és immobilizált (pl. származtatott ügyletekkel összefüggésben) és így nem újrafelhasználható zálogba helyezett alpletéteket nem kell bevonni a becslésbe.

405. Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelezésnél a biztosíték újrafelhasználhatósága nem csak az ügyletben használt biztosítéki megállapodás típusától függ, hanem azoktól a szerződéses korlátozásoktól is („újbóli elzálogosítási limit”), amelyekben a kiemelt bróker és ügyfele megállapodott. Ezt a limitet az értékpapírügylethez kapcsolódó hitel napi fennálló összegének rögzített százalékaként számítják ki. A biztosíték újrafelhasználhatósága érdekében a limiten belül először azokat az értékpapírokat kell átvezetni az ügyfél számlájáról a kiemelt bróker saját számlájára, amelyekhez újbóli elzálogosítási jog kapcsolódik. Az ESMA azt javasolja, hogy az újrafelhasználási képlet kiszámításához a *kapott, újrafelhasználható biztosítékokból* ki kell zárni azokat a biztosítékba adott értékpapírokat, amelyeket az újbóli elzálogosításra vonatkozó szerződéses korlátozás miatt nem lehet átvezetni a kiemelt bróker saját számlájára. A letétbe helyezett, de nem átruházott értékpapírokat nem szabad a számításba bevonni. Az ilyen értékpapírok bevonása a ténylegesen újrafelhasznált biztosítékok összegének túlbecsüléséhez vezetne.

406. Hasonló módon a nyújtott biztosíték a következőket rögzíti:

- a. repoügyletekben és vétel-eladás ügyletekben biztosítékként nyújtott értékpapírok;
- b. kölcsönbe adott értékpapírok
- c. értékpapír-kölcsönzési ügyletben biztosítékként nyújtott értékpapírok
- d. biztosítékként nyújtott értékpapírok az értékpapír-finanszírozási ügyletből származó változó letéti követelmények teljesítésére.

407. Az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet hatálya alá nem tartozó ügyletek részeként kapott vagy adott minden értékpapírt, ideértve a KBER szerződő felekkel végrehajtott értékpapír-finanszírozási ügyleteket is ki kell zárni az újrafelhasználási képletből.

408. A központi szerződő feleknek ki kell zárniuk az újrafelhasználásra vonatkozó becsléseikből a klíringtagok között a központi elszámolási tevékenységük részeként átadott biztosítéki értékpapírokat. Ez vonatkozik a képlet „Kapott biztosíték” és „Újrafelhasznált biztosíték” összetevőire is. Ezeket a biztosítéki értékpapírokat a központi szerződő fél önmagában nem használja fel újra, mivel az értékpapírok átruházása inkább a megújítási folyamatot tükrözi, amelyre akkor kerül sor, amikor egy központi szerződő fél a két eredeti szerződő fél közé iktatja be magát. A letétként kapott biztosítéki

értékpapírokat adott esetben be kell vonni a becslésekbe, és a központi szerződő felekkel szemben elvárás, hogy adatot szolgáltatassanak minden olyan újrafelhasználásról, amelyre egyéb tevékenységeik keretében kerül sor. Ez magában foglalja a vagyionkezelési műveleteket és minden egyéb típusú eszközt vagy mechanizmust (pl. fordított értékpapírkölcsönöket), amelyek esetleg érvényben vannak a központi szerződő feleknél.

409. Az FSB-keretrendszerébe tartozó biztosíték-újrafelhasználási mutatókat¹⁸ illetően, ezeket közvetlenül a nemzeti vagy globális hatóságok fogják kiszámítani a szervezetek által bejelentett biztosíték-újrafelhasználás alapján. Az újrafelhasználási arányhoz a hatóságoknak ki kell számítaniuk a nevezőt a szervezetek által a 2. táblázatban szolgáltatott adatok alapján.

5.6.1.1 Értékpapírok újrafelhasználása pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél által az adatszolgáltatási feladatok átruházása nélkül

410. A 101. táblázat egy olyan esetet mutat be, ahol „B” szerződő fél az újrafelhasznált értékpapírok értékét IT00BH4HKS39 ISIN-kóddal és 10 000 000 euró összegben bejelenti be.

| 101.táblázat –Értékpapírok újrafelhasználása pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél által az adatszolgáltatási feladatok átruházása nélkül | | | |
|--|-----------------------------------|-------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | <Rpt> <CollReuseUpd> |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty B | <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty B | <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> |
| 6 | Type of collateral component | SECU | <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptgCtrPty> |
| 7 | Collateral component | {ISIN} | <NttyRspnsblForRpt> |
| 8 | Value of reused collateral | | <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 9 | Estimated reuse of collateral | 10000000 | </CtrPtyData> <CollCmpnt> |
| 10 | Reused collateral currency | EUR | <Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> |
| 18 | Action type | REUU | <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> |

¹⁸⁹ Lásd a nem készpénz formájú biztosíték újrafelhasználására vonatkozó FSB-keretrendszer 4. pontját.

101.táblázat –Értékpapírok újrafelhasználása pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél által az adatszolgáltatási feladatok átruházása nélkül

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre> |

5.6.1.2 Értékpapírok újrafelhasználása pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél által az adatszolgáltatási feladatok átruházása mellett

411. A 102. táblázat azt az esetet mutatja be, ahol „A” szerződő fél az adatszolgáltatási feladatokat „B” szerződő félre ruházza át. „B” az újrafelhasznált értékpapírok értékét IT00BH4HKS39 ISIN-kóddal és 10 000 000 euró összegben jelenti be.

102.táblázat – Értékpapírok újrafelhasználása pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél által az adatszolgáltatási feladatok átruházása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|-------------------------|--|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> |
| 6 | Type of collateral component | SECU | <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty> |
| 7 | Collateral component | {ISIN} | <NttyRspnsblForRpt> |
| 8 | Value of reused collateral | | <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 9 | Estimated reuse of collateral | 10000000 | </CtrPtyData> <CollCmpnt> |
| 10 | Reused collateral currency | EUR | <Scty> <ISIN> IT00BH4HKS39</ISIN> |

102. táblázat – Értékpapírok újrafelhasználása pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél által az adatszolgáltatási feladatok átruházása mellett

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------|---------|---|
| 18 | Action type | REUU | <pre> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre> |

5.6.1.3 Értékpapírok kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása egy szerződő féllel

412. A 103. táblázat azt az esett mutatja be, amikor „C” szerződő fél egy kkv nem pénzügyi szerződő fél, és csak egyetlen szervezettel, „B” szerződő féllel (pénzügyi szerződő) kötött értékpapír-finanszírozási ügyletet. „B” szerződő fél az újrafelhasznált értékpapírok értékét IT00BH4HKS39 ISIN-kóddal és 10 000 000 euró összegben jelenti be.

103. táblázat – Értékpapírok kkv pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása egy szerződő féllel

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|-------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHJKLMN</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI> ABCDEFGHIJKLMNOPQRST</LEI> </pre> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty C | |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty B | |
| 6 | Type of collateral component | SECU | |
| 7 | Collateral component | {ISIN} | |
| 8 | Value of reused collateral | | |

| 103. táblázat – Értékpapírok kkv pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása egy szerződő féllel | | | |
|---|-------------------------------|----------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 9 | Estimated reuse of collateral | 10000000 | </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> |
| 10 | Reused collateral currency | EUR | |
| 18 | Action type | REUU | |

5.6.1.4 Értékpapírok kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása több szerződő féllel

413. A 104. és 105. táblázat azokat az információkat tartalmazza, amelyeket a kkv nem pénzügyi szerződő fél általi, több szerződő féllel való újrafelhasználással kapcsolatban kell bejelenteni. Ebben a példában két táblázat szerepel. Azonban annyi táblázat lehet, ahány szerződő féllel a kkv nem pénzügyi szerződő fél értékpapír-finanszírozási ügyletet kötött, és később újrafelhasználta a biztosítékot.
414. Ebben az esetben „C” szerződő fél egy kkv nem pénzügyi szerződő fél, és két szervezettel kötött értékpapír-finanszírozási ügyletet: „B” és „D” szerződő féllel. „B” szerződő fél a 104. táblázatban bejelenti az újrafelhasznált értékpapírok értékét IT00BH4HKS39 ISIN-kóddal és 10 000 000 euró összegben. „D” szerződő fél a 105. táblázatban az újrafelhasznált értékpapírok értékét FR00BH4HKS3 ISIN-kóddal és 2 000 000 euró összegben jelenti be.

| 104. táblázat – Értékpapírok kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása több szerződő féllel (1) | | | |
|--|---------------------|----------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |

104. táblázat – Értékpapírok kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása több szerződő féllel (1)

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|-------------------------|---|
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty C | <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty B | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> |
| 6 | Type of collateral component | SECU | <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> |
| 7 | Collateral component | {ISIN} | <NttyRspnsblForRpt> |
| 8 | Value of reused collateral | | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 9 | Estimated reuse of collateral | 10000000 | </CtrPtyData> <CollCmpnt> |
| 10 | Reused collateral currency | EUR | <Scty> <ISIN> IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd |
| 18 | Action type | REUU | Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> |

105. táblázat – Értékpapírok kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása több szerződő féllel (2)

| No | Field | Example | XML Message |
|----|--------------------------|-------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T18:41:07Z | <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | <Rpt> <CollReuseUpd> |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty D | ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> |

105. táblázat – Értékpapírok kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrafelhasználása több szerződő féllel (2)

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|-------------------------|--|
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty C | <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty D | <LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> |
| 6 | Type of collateral component | SECU | <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> |
| 7 | Collateral component | {ISIN} | <NttyRspnsblForRpt> |
| 8 | Value of reused collateral | | <LEI>11223344556677889900</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 9 | Estimated reuse of collateral | 2000000 | </CtrPtyData> <CollCmpnt> |
| 10 | Reused collateral currency | EUR | <Scty> <ISIN> FR00BH4HKS3</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd |
| 18 | Action type | REUU | Ccy="EUR">2000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> |

5.6.2 Pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetése

415. A szerződő feleknek akkor kell adatot szolgáltatniuk a pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetéséről, ha pénzeszközt használnak biztosítékként az értékpapír-kölcsönzési és értékpapír-kölcsönvételi ügyletekben és azt akár közvetlenül a kölcsönnyújtó (a biztosíték fogadója), akár a kölcsönnyújtó nevében egy ügynök újrabefekteti. Az újrabefektetés bejelentése az érintett pénzügyi szerződő fél típusától, pl. bróker, kereskedő, befektetési vállalkozás stb. függetlenül történik. Ez az adott értékpapír-finanszírozási ügyletben betöltött pozíciójához kapcsolódik.
416. Az újrabefektetés típusát (4.12. mező) és az újrabefektetett pénzeszköz összegét (4.13. mező) a pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetésének pénzneme szerinti bontásban kell megadni (4.14. mező). Mivel a szerződő felek várhatóan egyetlen újrabefektetési arányt jelentenek be pénznemek szerinti bontás nélkül, az újrabefektetési arányt (4.11. mező) az újrabefektetett pénzeszköz összege alapján súlyozott átlagos

arányként kell kiszámolni (4.13. mező) a újrabefektetett pénzeszköz pénznemébe való átváltást követően (4.14. mező).

417. A nem központilag elszámolt értékpapír-finanszírozási ügyletekben letétnyújtási céllal kapott és később újrabefektetett pénzeszköz szintén az adatszolgáltatás hatálya alá tartozik.
418. Az értékpapírügylethez kapcsolódó hitelből kapott és később újrabefektetett pénzeszközökről nem kell pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetéseként adatot szolgáltatni. Az értékpapírügyletekhez kapcsolódó hitelekkel összefüggésében a pénzeszközben nyújtott biztosítékra vonatkozó adatszolgáltatást illetően lásd az 5.3.16. szakaszt.
419. Abban az esetben, ha az adatszolgáltató szerződő fél nem tud különbséget tenni a saját pénzeszközei és a pénzeszközben nyújtott biztosítékként kapott pénzeszközök között, a pénzeszköz-újrabefektetés összegét ugyanazzal a módszerrel kell kiszámolni, mint a nem pénzeszközben nyújtott biztosíték esetében.
420. A központi szerződő felek által (a rájuk vonatkozó letéti követelmények részeként) kapott, pénzeszközben nyújtott biztosíték és a pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetése már nyilvánosan elérhető a CPMI-IOSCO nyilvános mennyiségi közzétételeiből¹⁹. Bár az adatszolgáltatás az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet alapján napi szinten történik (nem pedig negyedévente, ahogy a nyilvános mennyiségi közzétételek esetében), a gyűjtött információk részletezettségének és típusának összehasonlítható szintje nem indokolja a kiegészítő adatszolgáltatást. A központi szerződő felek pénzeszközben nyújtott biztosítékának újrabefektetése ezért kizárt.
421. Végezetül, a pénzeszközben nyújtott biztosíték újrabefektetésére vonatkozó adatszolgáltatást illetően a feleknek figyelembe kell venniük az FSB ezzel összefüggésben kiadott minden későbbi útmutatását vagy pontosítását.

5.6.2.1 Pénzeszközök pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése az adatszolgáltatási feladatok átruházása nélkül

422. A 106. táblázat azt az esetet mutatja, amelyben „B” szerződő fél bejelenti a saját 100 000 euró összegű pénzeszköz-újrabefektetését a repopiacon 1,5 %-os kamat mellett.

| 106. táblázat – Pénzeszközök pénzügyi szerződő fél vagy nem kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése az adatszolgáltatási feladatok átruházása nélkül | | | |
|---|---------------------|----------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |

¹⁹ CPMI-IOSCO, 2015. február, „A központi szerződő feleket érintő mennyiségi közzétételekre vonatkozó standardok”: <https://www.bis.org/cpmi/publ/d125.pdf>.

| 106. táblázat – Pénzeszközök pénzügyi szerződő fél vagy nem kvv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése az adatszolgáltatási feladatok átruházása nélkül | | | |
|---|-------------------------------------|-------------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty B | <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty B | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> |
| 11 | Reinvestment Rate | 1.5 | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty> |
| 12 | Type of re-invested cash investment | REPM | <NttyRspnsblForRpt> |
| 13 | Re-invested cash amount | 100000 | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> |
| 14 | Re-invested cash currency | EUR | </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> |
| 18 | Action type | REUU | <CshRinvstmtRate>1.5</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> |

5.6.2.2 Pénzeszközök pénzügyi szerződő fél vagy nem kvv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése az adatszolgáltatási feladatok átruházása mellett

423. A 107. táblázat azt az esetet mutatja be, ahol „A” szerződő fél a pénzeszköz újrabefektetésére vonatkozó adatszolgáltatási feladatokat átruházza „B” szerződő félre. „B” szerződő fél 100 000 euró összegű pénzeszköz újrabefektetését jelenti be a repociacon, 1 %-os kamattal.

| 107. táblázat – Pénzeszközök pénzügyi szerződő fél vagy nem kvv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése az adatszolgáltatási feladatok átruházása mellett | | | |
|--|-------------------------------------|-------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty A | |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty A | |
| 11 | Reinvestment Rate | 1 | |
| 12 | Type of re-invested cash investment | REPM | |
| 13 | Re-invested cash amount | 100000 | |
| 14 | Re-invested cash currency | EUR | |
| 18 | Action type | REUU | |

5.6.2.3 Pénzeszközök kvv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése egy szerződő féllel

424. A 108. táblázat azt az esetet mutatja be, amikor „C” szerződő fél kvv nem pénzügyi szerződő fél, és egyetlen szervezettel, „B” szerződő féllel kötött értékpapír-finanszírozási

ügyletet. „B” szerződő fél 100 000 euró összegű pénzeszköz újrabefektetését jelenti be a repopiacon, 1 %-os kamattal.

| 108. táblázat – Pénzeszközök kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése egy szerződő féllel | | | |
|---|-------------------------------------|-------------------------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <pre> <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> </Csh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} OF counterparty B | |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty C | |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty B | |
| 11 | Reinvestment Rate | 1 | |
| 12 | Type of re-invested cash investment | REPM | |
| 13 | Re-invested cash amount | 100000 | |
| 14 | Re-invested cash currency | EUR | |
| 18 | Action type | REUU | |

5.6.2.4 Pénzeszközök kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése több szerződő féllel

425. A 109. és 110. táblázat azokat az információkat tartalmazza, amelyeket a biztosíték kkv nem pénzügyi szerződő fél általi, több szerződő féllel való újrabefektetésével kapcsolatban kell bejelenteni. Ebben a példában két táblázat szerepel. Azonban annyi táblázat lehet, ahány szerződő féllel a kkv nem pénzügyi szerződő fél értékpapír-finanszírozási ügyletet kötött, és később újrabefektette a pénzeszközökben nyújtott biztosítékot.
426. Ebben az esetben „C” szerződő fél egy kkv nem pénzügyi szerződő fél, és két szervezettel kötött értékpapír-finanszírozási ügyletet: „B” szerződő féllel és „D” szerződő féllel. „B” szerződő fél a 109. táblázatban 100 000 euró összeget jelent be újrabefektetett pénzeszközökben nyújtott biztosítékként. „D” szerződő fél a 110. táblázatban jelenti be a 100 000 euró összeget újrabefektetett pénzeszközökben nyújtott biztosítékként.

| 109. táblázat – Pénzeszközök kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése több szerződő féllel(1) | | | |
|---|-------------------------------------|-------------------------|--|
| No | Field | Example | XML Message |
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <pre> <SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> </Csh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </pre> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty C | |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty B | |
| 11 | Reinvestment Rate | 1 | |
| 12 | Type of re-invested cash investment | REPM | |
| 13 | Re-invested cash amount | 100000 | |
| 14 | Re-invested cash currency | EUR | |
| 18 | Action type | REUU | |

109. táblázat – Pénzeszközök kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése több szerződő féllel(1)

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre> |

110. táblázat – Pénzeszközök kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése több szerződő féllel(2)

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------------|--------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>11223344556677889900</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> <CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </pre> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty D | |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty C | |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI2} of counterparty D | |
| 11 | Reinvestment Rate | 1 | |
| 12 | Type of re-invested cash investment | REPM | |
| 13 | Re-invested cash amount | 100000 | |
| 14 | Re-invested cash currency | EUR | |
| 18 | Action type | REUU | |

110. táblázat – Pénzeszközök kkv nem pénzügyi szerződő fél általi újrabefektetése több szerződő féllel(2)

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre> |

5.6.3 Nincs nem pénzeszközben nyújtott biztosíték újrafelhasználása és pénzeszköz-újrabefektetés

427. A 111. táblázat a mezők abban az esetben történő kitöltését szemlélteti, amikor sem pénzeszközökben nyújtott biztosíték újrafelhasználására, sem pénzeszközökben nyújtott biztosíték újrabefektetésére nem kerül sor. Ezért a szerződő feleknek az adatszolgáltatást a 111. táblázatnak megfelelően kell elvégezniük.

428. Ebben az esetben a szabályozástechnikai standardok 4. táblázatának 12. mezőjében („Az újrabefektetett pénzeszköz-befektetés típusa”) „egyéb” értéket kell megadni.

111. táblázat – Nincs pénzeszköz-biztosíték újrafelhasználása

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------------------------------------|--------------------------|--|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>11223344556677889900</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>11223344556677889900</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> </pre> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty D | |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty C | |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI2} of counterparty D | |
| 6 | Type of collateral component | CASH | |
| 12 | Type of re-invested cash investment | OTHR | |
| 13 | Re-invested cash amount | 0 | |
| 14 | Re-invested cash currency | EUR | |

111. táblázat – Nincs pénzeszköz-biztosíték újrafelhasználása

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-------|---------|--|
| | | | <pre> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>OTHR</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">0</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 _</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> </pre> |

5.6.4 Finanszírozási források

429. A finanszírozási forrásokhoz tartozó mezők tekintetében csak akkor kell adatszolgáltatást végezni, ha van értékpapírügyletnek kapcsolódó fennálló hitel vagy fennálló rövid piaci érték. Az adatszolgáltató szerződő feleknek vagy a tájékoztatásért felelős szervezeteknek ezt az információt az adatszolgáltató szerződő fél szintjén, nem pedig az egyedi ügylet szintjén kell megadnia.
430. A 112. táblázat azt az esetet mutatja, amikor a B szerződő fél egy 5 000 000 euró összeget jelent be a repo piacról származó finanszírozási forrásként az értékpapírügyletnek kapcsolódó hitelek finanszírozásához.

112. táblázat – Finanszírozási források

| No | Field | Example | XML Message |
|----|-----------------------------------|-------------------------|---|
| 1 | Reporting timestamp | 2020-04-22T16:41:07Z | <pre> <SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn> <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> </pre> |
| 2 | Event date | 2020-04-23 | |
| 3 | Report submitting entity | {LEI} of counterparty B | |
| 4 | Reporting counterparty | {LEI} of counterparty B | |
| 5 | Entity responsible for the report | {LEI} of counterparty B | |

| 112. táblázat – Finanszírozási források | | | |
|---|-------------------------------------|---------|---|
| No | Field | Example | XML Message |
| 15 | Funding sources | REPO | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> |
| 16 | Market value of the funding sources | 5000000 | </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> |
| 17 | Funding sources currency | EUR | <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> ... </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> |
| 18 | Action type | REUU | <FndgSrc> <Tp>REPO</Tp> <MktVal Ccy="EUR">5000000</MktVal> </FndgSrc> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> |

6 Elutasítási visszajelzés

431. Az adatgyűjtésre vonatkozó szabályozástechnikai standardok 1. cikkének (1) bekezdése rendelkezik azokról a különféle ellenőrzésekről, amelyeket a kereskedési adattárnak az értékpapír-finanszírozási ügylet értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikke értelmében bejelentett adatai pontosságának és teljességének garantálása érdekében kell elvégeznie.
432. A kereskedési adattárnak elutasítási visszajelzést kell adnia a következő elutasítási kategóriáknak megfelelően:
- a beadvány séma-ellenőrzése az adatgyűjtésről szóló szabályozástechnikai standard 1. cikke (1) bekezdésének b) pontja szerint
 - az adatszolgáltatást végző szervezet engedélyezése az adatgyűjtésről szóló szabályozástechnikai standardok 1. cikke (1) bekezdésének c) pontja szerint
 - a beadvány logikai ellenőrzése az adatgyűjtésről szóló szabályozástechnikai standardok 1. cikke (1) bekezdésének d)–j) pontja szerint
 - az üzleti szabályok vagy a beadvány tartalmi ellenőrzése az adatgyűjtésről szóló szabályozástechnikai standardok 1. cikke (1) bekezdésének k) pontja, és az ellenőrzési szabályokban foglaltak, valamint a ezen útmutatásokban meghatározottak szerint

433. Érdemes megjegyezni, hogy egy szervezet hitelesítését a kereskedési adattár végzi a kereskedési adattár rendszeréhez való csatlakozás időpontjában, ezért nem érkezik konkrét elutasítási visszajelzés.
434. A kereskedési adattárnak igazolnia kell, hogy a fájl (az egész fájl és az adott ügyletjelentések szintaxisa) megfelel az XML-sémának. Amennyiben a fájl nem felel meg, az egész fájl (az adott fájlban szereplő összes ügylet) elutasításra kerül, az indoklás pedig az lesz, hogy a fájl „sérült”.
435. Mivel az adatgyűjtésről szóló szabályozástechnikai standardok 1. cikke (1) bekezdésének c) pontja kimondja, hogy ennek az ellenőrzésnek a kereskedési adattárnak készült jelentések ellenőrzésének részeként kell megtörténnie, és miközben az engedélyezési kapcsolat létrehozható a felvétel során, az adatszolgáltatásra vonatkozó engedélyt szintén ellenőrizni kell a benyújtási szinten, és a kereskedési adattárnak a megfelelő visszajelzési üzenettel el kell utasítania minden olyan beadványt, amely esetében az ellenőrzés sikertelen.
436. A kereskedési adattáraknak a vonatkozó ISO 20022 szabvány szerinti XML-üzenetet kell használniuk a validáló visszajelzés küldésére azon szervezetek számára, akit felvett az adott kereskedési adattár. A kereskedési adattáraknak az adatszolgáltatási mezőkben szereplő kódokat kell használniuk, amikor közlik a szerződő felekkel az elutasítást.
437. Az elutasítás kézhezvételét követően az adatszolgáltató szerződő feleknek vagy a tájékoztatásért felelős szervezetnek vagy közvetlenül, vagy az adatszolgáltatást végző szervezeten keresztül hiánytalan és pontos adatokat kell szolgáltatniuk az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikkének (1) bekezdésében meghatározott adatszolgáltatási határidőn belül.
438. Ha egy fájl 3 ügyletet tartalmaz, de az ügyletek ellenőrzése sikertelen, a statisztika a fájlt 3 elutasított ügylettel elfogadottnak mutatja.
439. Ha az adatszolgáltató szerződő fél, a tájékoztatásért felelős szervezet, vagy az adatszolgáltatást végző szervezet által benyújtott adatfájl súlyos sémahibát tartalmaz, és az ügyleteket nem lehet ellenőrizni, akkor ez 1 fájl elutasításaként jelenik meg.
440. A fenti információk mellett a kereskedési adattárak minden adatszolgáltató szerződő fél, tájékoztatásért felelős szervezet vagy adott esetben adatszolgáltatást végző szervezet számára a következő információkat tartalmazó napvégi jelentést (auth.084.001.01) biztosítanak:

| 113. táblázat – Elutasítási visszajelzés | | | |
|--|--------------------------|------------------------|--|
| No. | Field | Details to be reported | XML Message |
| 1 | Number of files received | Numeric values | <SctiesFincgRptgTxStsAdv <TxRptStsAndRsn> <Rpt> <RptSttstcs> <TtlNbOfRpts>2</TtlNbOfRpts> <TtlNbOfRptsAccptd>1</TtlNbOfRptsAccptd> |
| 2 | No. of files accepted | Numeric values | |
| 3 | No. of files rejected | Numeric values | |
| 4 | File identification | Textual value | |
| 5 | Rejection reason | Error code | |
| 6 | Rejection description | Error description | |
| 7 | Number of SFTs received | Numeric values | |

| | | | |
|----|---------------------------|-------------------|---|
| 8 | Number of SFTs accepted | Numeric values | |
| 9 | Number of SFT s rejected | Numeric values | <TtlNbOfRptsRjctd>1</TtlNbOfRptsRjctd> |
| 10 | Identification of the SFT | | <NbOfRptsRjctdPerErr> <DtldNb>1</DtldNb> |
| 11 | Reporting counterparty | Table A Field 3 | <RptSts> |
| 12 | UTI | Table B Field 1 | <MsgRptld>ReportID</MsgRptld> |
| 13 | Other counterparty | Table A Field 11 | <Sts>RJCT</Sts> |
| 14 | Master agreement type | Table B Field 9 | <DtldVldtnRule> |
| 15 | Rejection reason | Error codes | <Id>RuleID</Id> <Desc>Rule description</Desc> <SchmeNm> <Cd>1</Cd> </SchmeNm> </DtldVldtnRule> |
| | | | </RptSts> </NbOfRptsRjctdPerErr> </RptSttstcs> <TxSttstcs> <TtlNbOfTxs>2</TtlNbOfTxs> |
| | | | <TtlNbOfTxsAccptd>1</TtlNbOfTxsAccptd> |
| | | | <TtlNbOfTxsRjctd>1</TtlNbOfTxsRjctd> <NbOfTxsRjctd> <Txld> <Tx> <RptgCtrPty> |
| | | | <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> |
| | Rejection description | Error description | <LEI>1234567890123450000</LEI> </OthrCtrPty> |
| | | | <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <Vrsn>2019</Vrsn> </MstrAgrmt> </Tx> </Txld> <Sts>RJCT</Sts> <DtldVldtnRule> <Id>RuleID</Id> <Desc>Rule description</Desc> </DtldVldtnRule> </NbOfTxsRjctd> </TxSttstcs> </Rpt> </TxRptStsAndRsn> </SctiesFincgRptgTxStsAdv< |
| 16 | | | |

441. Ez biztosítja, hogy abban az esetben, ha az adatszolgáltató szerződő fél vagy a tájékoztatásért felelős szervezet nem közvetlenül a keredési adatár felé szolgáltat adatot, hanem annak csak betekintési jogosultsága van, részletesen megismerhesse az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet szerinti adatszolgáltatási kötelezettségnek való megfelelést.

7 Egyeztetési visszajelzés

442. A kereskedési adattárak közötti egyeztetési folyamat végrehajtása során a kereskedési adattárak összepárosítják a kölcsönöket, majd i. egyeztetik a kölcsönöket a kölcsönökre vonatkozó egyeztetendő mezőkben, és ezzel párhuzamosan ii. egyeztetik a biztosítékot a biztosítékra vonatkozó egyeztetendő mezőkben. A biztosíték így tehát nem kerül párosításra függetlenül attól, hogy ügyletalapú vagy nettó kitétségi alapon nyújtott biztosítékról van-e szó. Csak a hiteleket kell összepárosítani, és mind az ügyletalapú, mind a nettó kitétségi alapon nyújtott biztosítékokra vonatkozó hitelekkel kapcsolatos biztosítékokat egyeztetik. A kereskedési adattáraknak nem kell összepárosítaniuk a biztosítékokat, és ebben az esetben, ha az egyik oldal nem nyújt nettó kitétségi alapú biztosítékot, akkor minden egyes biztosítéki eszközt az Egyeztetési eredmények státuszáról szóló jelentésben a „Nem összepárosított” alatt kell bejelenteni, a biztosíték egyeztetésének státusza pedig „Nem egyeztetett” lesz.

| 114. táblázat – Egyeztetési kategóriák | |
|---|---------------------------|
| Reconciliation categories | Allowable values |
| Reporting type | Single-sided/dual-sided |
| Reporting requirement for both counterparties | Yes/No |
| Pairing Status | Paired/unpaired |
| Loan reconciliation status | Reconciled/not reconciled |
| Collateral reconciliation status | Reconciled/not reconciled |
| Further modifications: | Yes/No |

443. Az „EROR” intézkedéstípusú üzenet kézhezvétele és elfogadása után, az ellenőrzést követően, a kereskedési adattárak azonnal el kell távolítani egy adott értékpapír-finanszírozási ügyletet az egyeztetésből, azaz a közvetlenül következő egyeztetési ciklusból.

444. Ezenkívül egyetlen értékpapír-finanszírozási ügyletet sem lehet megújítani, ezért az értékpapír-finanszírozási ügyletet a lejárat napját vagy annak idő előtti lezárását követő 30 napra ki kell zárni az összeegyeztetésből, vagyis „Lezárás/Idő előtti lezárás” vagy „Pozíció-összetevő” intézkedéstípusként kell bejelenteni az ellenőrzésre vonatkozó szabályozástechnikai standardok 2. cikke (2) bekezdésének h) pontja alapján. Ezenkívül a biztosítékok részleteinek egyeztetése esetén ezek az üzenetek abban különböznek a hitelekre vonatkozó üzenetektől, hogy azokban nem szerepel a lejárat napja. A nettó kitétségi alapon nyújtott biztosítékok esetében ez azt jelenti, hogy annak időpontja kapcsolódik az értékpapír-finanszírozási ügylet hiteloldalának dátumához. Ezért a

kereskedési adattárnak törekednie kell ezen információk egyeztetésére a nettó kitétségi alapon nyújtott biztosítékkal való fedezésbe bevont utolsó hitel megszűnését vagy lejáratát követő harminc napon belül. Ezenkívül a nettó kitétségi alapon nyújtott biztosíték esetében a biztosíték egyeztetésének státuszát meg kell ismételni minden, a nettó kitétségi alapon nyújtott biztosítékkal való fedezésbe bevont értékpapír-finanszírozási ügylet esetében.

445. Ha mindkét szerződő félre vonatkozóan adatszolgáltatási kötelezettség áll fenn, biztosítaniuk kell, hogy a bejelentett értékpapír-finanszírozási ügyletek rendelkezzenek „Párosítva” párosítási státusszal, „Egyeztetett” kölcsön-egyeztetési státusszal és „Egyeztetett” biztosíték-egyeztetési státusszal.
446. Ennek megkönnyítése érdekében a kereskedési adattárak a következő jelentést biztosítják a számukra, amely részletes információkat tartalmaz minden egyes, általuk bejelentett és egyeztetendő értékpapír-finanszírozási ügylet egyeztetési státuszáról:

| 115. táblázat – Egyeztetési visszajelzés | | | | |
|--|----------------------------|--|------------------------|---|
| No. | Field | | Details to be reported | XML Message |
| 1 | Reporting counterparty | Unique key | Table A Field 3 | <SciesFincgRptgRcncltnStsAdv> <RcncltnData> <Rpt> <PaigrRcncltnSts> <DtldNbOfRpts>2</DtldNbOfRpts> <DtldSts>PARD</DtldSts> </PaigrRcncltnSts> <RcncltnRpt> ... <Txld> <RptgCtrPty> <LEI>1234567890123450000</LEI> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </OthrCtrPty> <UnqTradldr>UT110</UnqTradldr> </Txld> <Modfd>>true</Modfd> <RcncltnSts> <RptgData> <NotMtchd> <CtrPty1> |
| 2 | UTI | | Table B Field 1 | |
| 3 | Other counterparty | | Table A Field 11 | |
| 4 | Master agreement type | | Table B Field 9 | |
| | Report status | | Paired/Reconciled | |
| | Reporting timestamp | Information on the last reporting timestamp pertaining to the SFT that is reconciled | Table A Field 1 | |
| | Modification status | Information if the transaction subject of reconciliation was modified | True/False | |
| | No Reconciliation required | Indication that the transaction is not subject of | True/False | |

| 115. táblázat – Egyeztetési visszajelzés | | | | |
|--|--|--|--|--|
| No. | Field | | Details to be reported | XML Message |
| | | reconciliation | | <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> |
| | Matching status | | True/False | </CtrPty1> <CtrPty2> |
| | Loan reconciliation status | | reconciled/not reconciled | <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE</LEI> |
| | Reportable loan fields subject of reconciliation | Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported | Loan fields of Table 1 of RTS on data verification | </CtrPty2> <MtchgCrit> <LnMtchgCrit> <TermntnDt> <Val1>2019-04-20 </Val1> <Val2>2019-04-21 </Val2> </TermntnDt> </LnMtchgCrit> <CollMtchgCrit> <CmpntTp> <Scty> <Qty> |
| | Collateral reconciliation status | | reconciled/not reconciled | <Val1>1234</Val1> <Val2>1243</Val2> </Qty> </Scty> </CmpntTp> </CollMtchgCrit> </MtchgCrit> </NotMtchd> </RptgData> </RcncltnSts> </RcncltnRpt> </Rpt> </RcncltnData> |
| | Reportable collateral fields subject of reconciliation | Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported | Collateral fields of Table 1 of RTS on data verification | </SctiesFincgRptgRcncltnStsAdv< |

447. Az értékpapír-finanszírozási ügyletek egyeztetésből való eltávolítása után ezeket az értékpapír-finanszírozási ügyleteket is el kell távolítani a szerződő felek és a hatóságok számára biztosított egyeztetési jelentésekből. A kereskedési adattáraknak meg kell őrizniük rendszerükben az értékpapír-finanszírozási ügyletek legutolsó egyeztetési státuszát.

8 Hiányzó biztosíték visszajelzés

448. Jelezni kell, hogy az értékpapír-finanszírozási ügylet biztosítékkal fedezett-e vagy sem. Amikor az értékpapír-finanszírozási ügylet biztosítékkal fedezett, a biztosítékra vonatkozó információkat, amint azok ismertté válnak, meg kell adni.
449. Amikor az adatszolgáltatás időpontjában még nem ismertek a biztosítékra vonatkozó információk, nem adják meg a konkrét biztosítéki adatokat – vagyis nem töltik ki a 2.75.–2.94. mezőt. Ehelyett a 2.96.mezőt kell kitölteni vagy a biztosítékkosár egy érvényes ISIN-kódjával, vagy a „NTAV” értékkel. Az értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó adatszolgáltatást elfogadják.
450. A nap végén a kereskedési adattár az adatgyűjtésről szóló szabályozástechnikai standardok 3. cikkének c) pontjával összhangban jelentést készít, amely tartalmazza „azon értékpapír-finanszírozási ügyletek egyedi ügyletazonosítóját, amelyek esetében az (EU) 2019/363 végrehajtási rendelet I. melléklete 2. táblázatának 72. mezőjében „hamis” szerepel, és ugyanezen táblázat 73–96. mezőjében a biztosítékra vonatkozó információkat még nem jelentették”. Tekintettel arra, hogy az egyes biztosíték-összetevőkre vonatkozó információkat a 2.75.–2.94. mező tartalmazza, hogy emlékeztesse a szervezeteket arra, hogy megadják a konkrét biztosítékkal kapcsolatos információkat, a kereskedési adattárnak készítenie kell egy „hiányzó biztosítékra vonatkozó jelentést”, amely tartalmazza azon értékpapír-finanszírozási ügyletek egyedi ügyletazonosítóját, amelyeket a szerződő fél biztosítékkal fedezettként jelentett be, és amelyekre vonatkozóan csak a 2.96. mezőt töltötték ki.
451. Abból az elvárásból adódóan, hogy az adatok hatékonyságának és szerződő felek általi felhasználhatóságának biztosítása érdekében a napközbeni értékpapír-finanszírozási ügyletekhez ne allokáljanak biztosítékot, a kereskedési adattáraknak ebbe a jelentésbe bele kell venniük azokat az értékpapír-finanszírozási ügyleteket, amelyek teljesítik az alábbi feltételeket:
- olyan értékpapír-finanszírozási ügyletek, amelyeknél a 2.72. mezőben „hamis” szerepel, és csak a 2.96. mezőt töltik ki;
 - olyan értékpapír-finanszírozási ügyletek, amelyeknél a végrehajtás időbélyegzőjének dátumrésze és a lejárat napja vagy a lezárás napja eltérő;
 - egyeztetés alá tartozó értékpapír-finanszírozási ügyletek.

9 Adatszolgáltatás a hatóságok számára

9.1 Határidő az adathozzáférés létrehozására

452. Az adatokhoz való hozzáférés időszerűségét illetően a kereskedési adattáraknak úgy kell kialakítaniuk belső folyamataikat, hogy a 4. cikk (1) bekezdésének f) pontjával összhangban a hatóság számára közvetlen és azonnali hozzáférést biztosítsanak az értékpapír-finanszírozási ügyletek adataihoz az azt követő harminc napon belül, hogy a hatóság benyújtotta az említett hozzáférés létrehozása iránti kérelmét.

453. A kereskedési adattáraknak a hatóságok által az adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardokban meghatározott formában biztosított információkat kell használniuk. A fióktelepekre és leányvállalatokra vonatkozóan az értékpapír-finanszírozási ügyletek adatait a meglévő jogalany-azonosítókra vonatkozó adatok figyelembevételével is meg kell adni a hatóságok számára.
454. Ezenkívül a szerződő felek által az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 4. cikke alapján bejelentett adatokhoz való hozzáférés biztosításakor a kereskedési adattáraknak az intézkedésre és státuszra vonatkozó fájlokba bele kell foglalniuk az ügylet- és pozíciószinten bejelentett értékpapír-finanszírozási ügyleteket.
455. Tekintettel az adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok 4. cikke (2) bekezdésének k) pontjában foglalt követelményekre, hozzáférést kell biztosítani az árukhoz, amennyiben azok érintett tagállamai azonosíthatók.
456. Tekintettel az adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok 4. cikke (2) bekezdésének n) pontjában foglalt követelményekre, ahol az értékpapír-finanszírozási ügyletekhez való hozzáférést a központi bank által kibocsátott pénznemben kell biztosítani, az adathozzáférésnek ki kell terjednie az összes olyan nem értékelési mezőre, amelyben a pénznemet használják. Ha több hatóság ugyanazt a pénznemet bocsátja ki, mint az euró esetében, mindegyiknek hozzáférést kell kapnia ezekhez az értékpapír-finanszírozási ügyletekhez.
457. Tekintettel az adatokhoz való hozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok 4. cikke (2) bekezdésének o) pontjában foglalt követelményekre, amelyek értelmében hozzáférést kell biztosítani azon referenciamutatókhoz kapcsolódó értékpapír-finanszírozási ügyletekhez, amelyeknek kezelője esetében az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 12. cikkének (2) bekezdésében foglalt szervezet az illetékes, a kereskedelmi adattárnak gondoskodnia kell arról, hogy megkapja az említett referenciamutatók releváns kezelőjének minőségét tanúsító információkat.

9.2 Működési megállapodások adathozzáféréshez

458. Az értékpapír-finanszírozási ügyleteknek az adatszolgáltatásról szóló szabályozástechnikai standardok mellékletében szereplő 1-4. táblázattal összhangban bejelentett adatait illetően, beleértve azoknak az ügyleteknek a legfrissebb kereskedési állapotát is, amelyek nem jártak le, illetve amelyeket nem kellett „Hiba”, „Lezárás/Idő előtti lezárás” vagy „Pozíció-összetevő” intézkedéstípusként bejelenteni az adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardok I. melléklete 2. táblázatának 98. mezőjében meghatározottak szerint, a kereskedési adattáraknak a következő XML-sablonfájlokat kell használniuk.
459. A vonatkozó kereskedés-aktivitási üzenetek: auth.052.001.01 (szerződő fél, hitel és biztosíték), auth.070.001.01 (letét), auth.071.001.01 (biztosíték újrafelhasználása). A vonatkozó állapotüzenetek: 079.001.01 (szerződő fél, hitel és biztosíték), auth.085.001.01 (letét), auth.086.001.01 (biztosíték újrafelhasználása). Ezeket a sablonfájlokat frissítették a következőkre vonatkozó sablonfájlok aktualizálását és pontosítását illetően: i. a repoügylet biztosítékának és a vétel-eladás ügylet biztosítékának bejelentése, ii. az

értékpapír-finanszírozási ügylet biztosítékának bejelentése, iii. a nettó kitétségi alapon nyújtott biztosíték bejelentése, iv. több biztosítéki eszköz.

460. Ezenkívül ugyanezeket a sablonfájlokat kell használni, amikor a kereskedési adattár választ készít a hitel és biztosítéki adatokra vonatkozó ismétlődő és eseti lekérdezésekre. A kereskedési adattárak nem kötelesek hozzáférést adni a letéti és újrafelhasználási adatokhoz eseti lekérdezésen keresztül, mivel a két jelentés egyikéhez sem tartoznak lekérdezhető mezők.

| 116. táblázat – Értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó jelentés – szerződő fél, hitel- és biztosítéki adatok | | | |
|--|------------------|--|---|
| No. | Field | Details to be reported | XML schema |
| 1 | Reportable field | Table 1 Field 1 to Field 18 Table 2 Field 1 to Field 99 | <pre> <SctiesFincgRptgTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SctiesFincgRptgTxStatRpt> </pre> |

461. Ezenkívül a szerződő felek, a tájékoztatásért felelős szervezet vagy az adatszolgáltatást végző szervezet a letéti és újrafelhasználási adatokat az adatvégi állapot szintjén jelentik be. Ez nem zárja ki azt, hogy egy adatszolgáltató szerződő fél, a tájékoztatásért felelős szervezet vagy az adatszolgáltatást végző szervezet ezt az információt több kötegben bejelentse.

462. A kereskedési adattárnak az auth.070.001.01 (letét) tevékenységi jelentésben a hatóságok rendelkezésére kell bocsátania az összes olyan értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó letéti jelentést, amelyet egy adott napon nyújtottak be, az auth.085.001.01 állapotjelentésben pedig meg kell adnia az adott esemény dátumára bejelentett összes értékpapír-finanszírozási ügylethez kapcsolódó letét legutolsó

állapotát, vagy ha az adott dátumra nem jelentettek adatokat, a legutolsó bejelentett információt.

| 117. táblázat – Értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó jelentés – letéti adatok | | | |
|---|------------------|-----------------------------------|--|
| No. | Field | Details to be reported | XML schema |
| 1 | Reportable field | Table 3 Field 1 to Field 20 | <pre> <SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPty> ... </CtrPty> <CollPrftlId>...</CollPrftlId> <PstdMrgnOrColl> ... </PstdMrgnOrColl> <RcvdMrgnOrColl> ... </RcvdMrgnOrColl> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt> </pre> |

463. Az újrafelhasználási adatokhoz való hozzáférés biztosításakor a kkv nem pénzügyi szerződő felet illetően, a kereskedési adattáraknak minden olyan információt a hatóságok rendelkezésére kell bocsátaniuk, amelyet „NEWT” és „REUU” intézkedéstípusként jelentettek be az adatszolgáltató szerződő félhez az adott esemény dátumára. A kereskedési adattáraknak a „Tájékoztatásért felelős szervezet” és a „Az adatszolgáltatást végző szervezet” mezőket kell használniuk az alkalmazandó esetek meghatározására. Amikor egy adott adatszolgáltató szerződő félhez egynél több tájékoztatásért felelős szervezet tartozik, és ezek ugyanazt az adatszolgáltatást végző szervezetet veszik igénybe, a kereskedési adattáraknak az adott esemény dátumára vonatkozó minden olyan biztosíték-újrafelhasználási jelentést be kell nyújtaniuk, amelyet benyújtottak az adatszolgáltató szerződő félre vonatkozóan.
464. A kereskedési adattáraknak az auth.071.001.01 tevékenységi jelentésben a hatóságok rendelkezésére kell bocsátaniuk az összes olyan értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó biztosíték-újrafelhasználási jelentést, amelyet egy adott napon nyújtottak be, az auth.086.001.01 állapotjelentésben pedig meg kell adnia az adott esemény dátumára bejelentett összes értékpapír-finanszírozási ügylethez kapcsolódó letét legutolsó

állapotát, vagy ha az adott dátumra nem jelentettek adatokat, a legutolsó bejelentett információt.

| 118. táblázat – Értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó jelentés – újrafelhasználási adatok | | | |
|--|------------------|--------------------------------------|---|
| No. | Field | Details to be reported | XML schema |
| 1 | Reportable field | Table 4 Field 1 to Field 18 | <pre> <SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt> <Stat> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <CollCmpnt> ... </CollCmpnt> ... <FndgSrc> ... </FndgSrc> <RcncltnFlg> ... </RcncltnFlg> <CtrctMod> ... </CtrctMod> ... </Stat> ... </SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt> </pre> |

465. A kereskedési adattár által elutasított értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó jelentés lényeges részleteit illetően, beleértve az előző munkanapon elutasított értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó jelentéseket és az elutasítás indokait is, az adatellenőrzésről szóló szabályozástechnikai standardok I. mellékletének 2. táblázatában foglaltaknak megfelelően a kereskedési adattáraknak ugyanazt az XML-sablonfájlt kell használniuk, mint a 113. „Elutasítási visszajelzés” táblázatban.

| 119. táblázat – Elutasítási jelentés | | | | |
|--------------------------------------|--------------------------|------------------------|------------------------|------------|
| No. | Field | Additional information | Details to be reported | XML schema |
| 1 | Number of files received | | Numeric values | |
| 2 | No. of files accepted | | Numeric values | |
| 3 | No. of files rejected | | Numeric values | |
| 4 | File identification | | Textual value | |
| 5 | Rejection reason | | Error code | |
| 6 | Rejection description | | Error description | |
| 7 | Number of SFT received | | Numeric values | |

| 119. táblázat – Elutasítási jelentés | | | | |
|--------------------------------------|---------------------------|------------------------|------------------------|------------|
| No. | Field | Additional information | Details to be reported | XML schema |
| 8 | No. of SFT accepted | | Numeric values | |
| 9 | No. of SFT s rejected | | Numeric values | |
| 10 | Identification of the SFT | | | |
| 11 | Reporting counterparty | Unique key of the SFT | Table 1 Field 3 | |
| 12 | UTI | | Table 2 Field 1 | |
| 13 | Other counterparty | | Table 1 Field 11 | |
| 14 | Master agreement type | | Table 2 Field 9 | |
| 15 | Rejection reason | | Error codes | |
| 16 | Rejection description | | Error description | |

466. Minden olyan bejelentett értékpapír-finanszírozási ügylet egyeztetési állapotát illetően, amelyre vonatkozóan a kereskedési adattár egyeztetést végzett az adatellenőrzésről szóló szabályozástechnikai standardnak megfelelően (azon értékpapír-finanszírozási ügyletek kivételével, amelyek lejártak vagy amelyekre „Hiba”, „Lezárás/Idő előtti lezárás” vagy „Pozíció-összetevő” intézkedéstípussal érkezett kereskedési jelentés több mint egy hónappal az egyeztetési folyamat dátumát megelőzően), az kereskedési adattárnak ugyanazt az XML-sablonfájlt kell használniuk, mint a 115. „Egyeztetési visszajelzés” táblázatban.
467. Az XSD aktualizálásra került annak érdekében, hogy lehetővé váljon az egyeztetési értékek megadása több biztosítéki elemhez mind a szerződő felek, a tájékoztatásért felelős szervezetek, az adatszolgáltatást végző szervezet, mind pedig a hatóság számára.
468. A biztosítékegyeztetés eredményeit csak egyszer kell bejelenteni minden olyan ügyletre vonatkozóan, amely egyazon keretmegállapodás-típus hatálya alá tartozik, és a biztosítékeszközökkel való fedezettség nettó kitettsége IGAZ.

| 120. táblázat – Értékpapír-finanszírozási ügyletek egyeztetése: állapotjelentés | | | | |
|---|------------------------|--|------------------------|------------|
| No. | Field | Additional information | Details to be reported | XML schema |
| 1 | Reporting counterparty | Unique key | Table 1 Field 3 | |
| 2 | UTI | | Table 2 Field 1 | |
| 3 | Other counterparty | | Table 1 Field 11 | |
| 4 | Master agreement type | | Table 2 Field 9 | |
| 5 | Report status | | Paired/Reconciled | |
| 6 | Reporting timestamp | Information on the last reporting timestamp pertaining to the SFT that is reconciled | Table 1 Field 1 | |
| 7 | Modification status | Information if the transaction subject of reconciliation was modified | True/False | |

| 120. táblázat – Értékpapír-finanszírozási ügyletek egyeztetése: állapotjelentés | | | | |
|---|--|--|---------------------------|------------|
| No. | Field | Additional information | Details to be reported | XML schema |
| 8 | No Reconciliation required | Indication that the transaction is not subject of reconciliation | True/False | |
| 9 | Matching status | | True/False | |
| 10 | Loan reconciliation status | | reconciled/not reconciled | |
| 11 | Reportable loan fields subject of reconciliation | Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported | | |
| 12 | Collateral reconciliation status | | reconciled/not reconciled | |
| 13 | Reportable collateral fields subject of reconciliation | Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported | | |

469. Lekérdezés kézhezvételekor a kereskedési adattáraknak ellenőrizniük kell, hogy a lekérdezés helyes-e, illetve a rendszereikben feldolgozható-e. Érvénytelen adatlekérdezések (pl. a lekérdezés nem megfelelő) esetén a kereskedési adattár visszajelzési üzenetet küld a hatóságnak arról, hogy a lekérdezés érvénytelen, és megadja a hiba típusának leírását.

```

<FinInstrmRptgStsAdv>
  <MsgStsAdv>
    <MsgSts>
      <RptSts>RJCT</RptSts>
      <VldtnRule>
        <Id>EXE-003</Id>
        <Desc>Description of the rule</Desc>
      </VldtnRule>
      <RefDt>2017-11-15T10:35:55Z</RefDt>
    </MsgSts>
  </MsgStsAdv>
</FinInstrmRptgStsAdv>

```

470. A kereskedési adattáraknak az eseti adatlekérdezéseket a benyújtásukat és ellenőrzésüket követően mihamarabb végre kell hajtaniuk, még nem munkanapokon is. Az eseti lekérdezések válaszadási határidejét az adathozzáféréssről szóló szabályozástechnikai rendelet 5. cikkének (4) bekezdése határozza meg:
- amennyiben a hozzáférést lezáratlan értékpapír-finanszírozási ügyletek vagy olyan értékpapír-finanszírozási ügyletek adataihoz kérik, amelyek lejártak vagy amelyek esetében a kérelem benyújtásának időpontját megelőző legfeljebb egy év során az adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardok I. melléklete 2. táblázatának 98. mezőjében említettek szerint „Hiba”, „Lezárás/Idő előtti lezárás” vagy „Pozíció-összetevő” intézkedéstípust tartalmazó jelentés készült: legkésőbb a hozzáférés iránti kérelem benyújtásának napját követő első naptári napon UTC-idő szerint 12:00 óráig;
 - amennyiben a hozzáférést olyan értékpapír-finanszírozási ügyletek adataihoz kérik, amelyek lejártak, vagy amelyek esetében a kérelem benyújtásának időpontját megelőző egy évnél hosszabb időszakban az adatszolgáltatásról szóló végrehajtás-technikai standardok I. melléklete 2. táblázatának 98. mezőjében említettek szerint „Hiba”, „Lezárás/Idő előtti lezárás” vagy „Pozíció-összetevő” intézkedéstípust tartalmazó jelentés készült: legkésőbb a hozzáférés iránti kérelem benyújtásának napját követő három munkanapon belül;
 - amennyiben az a) és a b) pont alá egyaránt tartozó értékpapír-finanszírozási ügyletek adataihoz kérnek hozzáférést: legkésőbb a hozzáférés iránti kérelem benyújtásának napját követő három munkanapon belül.
471. Ha az adatlekérdezés benyújtása és az első végrehajtási nap között egy napnál rövidebb idő áll rendelkezésre, akkor az első végrehajtás elhalasztható a következő végrehajtási napig a lekérdezésben megadott paraméterek alapján.
472. Ha egy lekérdezés végrehajtása technikai okok miatt sikertelen, a kereskedési adattáraknak hibaüzenetet kell küldeniük az ESMA rendszerének. A hibaüzenetnek ismertetnie kell a hiba típusát.
473. Az egyes adatlekérdezésekre adott válaszként a kereskedési adattár az összes olyan értékpapír-finanszírozási ügyletre vonatkozó adatokat tartalmazó válaszfájlt készít, amely megfelel a hatóság által meghatározott keresési kritériumoknak:
- eseti lekérdezésnél egyszeri válaszfájlt készít (lekérdezésenként egy válaszfájl);
 - ismétlődő lekérdezésnél a hatóság által meghatározott gyakorisággal rendszeresen elkészíti a válaszfájlokat.
474. A kereskedési adattáraknak lehetővé kell tenniük az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 12. cikkének (2) bekezdésében foglalt szervezetek számára, hogy meghatározzanak egy, a napitól eltérő adathozzáférési gyakoriságot. Egy ismétlődő lekérdezés végrehajtásának maximális időtartamának meghatározásakor a kereskedési adattáraknak figyelembe kell venniük az értékpapír-finanszírozási ügyletekről szóló rendelet 12. cikkének (2) bekezdésében felsorolt szervezetek szükségleteit, és mérsékelniük kell a rendszereik működését veszélyeztető kockázatokat.
475. Az adathozzáféréssről szóló szabályozástechnikai standardok 5. cikke nem említi azokat a határidőket, amelyeket a kereskedési adattáraknak követniük kellene egy olyan tervezett

karbantartás végrehajtása esetén, amely befolyásolja a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat, függetlenül a használt csatornától vagy formától.

476. A kereskedési adattáraknak gondosan meg kell tervezniük a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat befolyásoló tervezett karbantartást, hogy az ne essen egybe az Unióban következetesen elfogadott naptár, például a Target2 naptár szerint meghatározott munkanapokkal. Amennyiben kivételes körülmények között az egybeesik egy ilyen munkanappal, a tervezett karbantartást a rendes munkaidőn kívül kell elvégezni, vagyis nagyon kora reggel vagy nagyon késő este. A kereskedési adattáraknak biztosítaniuk kell, hogy a fent említett tervezett karbantartást ne olyan módon végezzék el, amely megakadályozza, hogy a hatóságok időben hozzáférhessenek a származtatott ügyletekkel kapcsolatos információkhoz.
477. A kereskedési adattáraknak elektronikus úton kell értesíteniük az összes hatóságot a tervezett karbantartási időpontok kezdő és befejezési dátumáról és idejéről.
478. Amennyiben létezik a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat befolyásoló éves tervezett karbantartási terve, a kereskedési adattár értesítheti az összes hatóságot erről a tervről éves szinten és legalább három munkanapos értesítési határidővel. Ezenkívül a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat befolyásoló tervezett karbantartásra vonatkozó minden további külön értesítést, amelyet nem éves szinten tesznek meg, a lehető leghamarabb, de legalább három munkanappal a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat befolyásoló tervezett karbantartás kezdő időpontja előtt kell megtenni.
479. A kereskedési adattárnak nyilvántartást kell vezetnie azokról a megfelelő értesítésekről, amelyek kérésre az ESMA rendelkezésére bocsáthatók. A tervezett karbantartási értesítésekre vonatkozó nyilvántartásoknak legalább a következő információkat kell tartalmazniuk: az értesítés időbélyegzője, a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat befolyásoló tervezett karbantartás kezdő és záró időpontja, valamint az értesített felhasználók megfelelő listája.
480. Az adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok 5. cikkének (5) bekezdése szerinti kérelem ellenőrzése esetén a kereskedési adattárnak vissza kell igazolnia az adathozzáférés iránti kérelem kézhezvételét és ellenőriznie kell annak pontosságát és teljességét a lehető leghamarabb, de a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat befolyásoló tervezett karbantartás véglegesítését követően legfeljebb hatvan percen belül.
481. Az adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok 5. cikkének (4) bekezdése szerinti adathozzáférés esetén a kereskedési adattárnak törekednie kell arra, hogy a lehető leghamarabb teljesítse a kérelmet, de legkésőbb a kereskedési adatár által a hatóságok számára nyújtott, adathozzáférés biztosítására irányuló szolgáltatásokat befolyásoló tervezett karbantartás elvégzését követő első naptári napon UTC-idő szerint 12:00 óráig. Az 5. cikk (4) bekezdésének b) és c) pontját ez nem érinti.

482. Nem tervezett karbantartás esetén a kereskedési adattárnak be kell tartania az adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok 5. cikkének (4) és (5) bekezdésében meghatározott határidőket, és ezeket a határidőket referenciának kell tekinteni a kereskedési adattár megfelelőségének értékelése során. A kereskedési adattáraknak az eljárásaikkal összhangban értesíteniük kell az ESMA-t a nem tervezett karbantartásokról.
483. A kereskedési adattárak által készített kimeneti fájlok formátuma ISO 20022 XML. Az adathozzáférésről szóló szabályozástechnikai standardok 1. és 2. cikkének értelmében a kimeneti fájloknak tartalmazniuk kell az értékpapír-finanszírozási ügyletekre vonatkozó adatok azon alhalmazát, amely a hatóság jogi megbízatására korlátozódik.
484. A kimeneti fájloknak az ügyleti adatok alhalmazát az adatlekérdezésben meghatározott kritériumoknak megfelelően kell tartalmazniuk. Amikor egy lekérdezésre adott válaszban a bejegyzések száma jelentős, a választ több fájlra kell felbontani.
485. A kimeneti fájlnak minden egyes ügyletre vonatkozóan tartalmaznia kell a szabályozástechnikai és a végrehajtás-technikai standardokban meghatározott, és a szerződő felek által a kereskedési adattáraknak bejelentett összes mezőt. Az adatlekérdezési kritériumok csak a lekérdezési paraméterek (lekérdezhető mezők) számát és következésképpen a kimeneti fájlban szereplő bejegyzések számát korlátozhatják, nem pedig az ügyletenként biztosított információk körét (vagyis a mezők ügyletenkénti számát).
486. Ha a lekérdezés végrehajtása nem eredményez ügyletet, a kereskedési adattár megfelelő visszajelzési üzenetet küld.