



European Securities and  
Markets Authority

# Pamatnostādnes

Ziņošana saskaņā ar VFDR 4. un 12. pantu



## Saturs

1	Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas.....	5
2	Darbības joma.....	6
3	Mērķis.....	7
4	Vispārīgi principi.....	8
4.1	Ziņošanas sākuma datums.....	8
4.2	Paziņojamo VFD skaita noteikšana.....	8
4.2.1	Tirgus darījumi, uz kuriem neattiecas VFD definīcija.....	8
4.2.2	Aspekti, kas saistīti ar jebkura veida VFD.....	9
4.2.3	Aspekti, kas saistīti ar repo darījumiem.....	10
4.2.4	Aspekti, kas attiecas uz pirkuma–atpārdevuma un pārdevuma–atpirkuma (BSB/SBB) darījumiem.....	10
4.2.5	Aspekti, kas saistīti ar vērtspapīru aizdošanu un aizņemšanos (SLB).....	11
4.2.6	Aspekti, kas saistīti ar preču VFD.....	11
4.2.7	Aspekti, kas saistīti ar maržinālajiem aizdevumiem.....	12
4.3	Ziņošana par CDP tīrvērtētiem VFD.....	13
4.4	Atbildības sadale saskaņā ar VFDR 4. panta 3. punktu.....	14
4.4.1	Vispārīgs gadījums.....	14
4.4.2	Trešās valsts finanšu darījumu partneri (TC-FC).....	14
4.4.3	Fondi.....	15
4.5	Ziņošanas brīvprātīga deleģēšana.....	15
4.6	VFDR ziņošanas pienākumu piemērošana filiāļu noslēgtiem VFD.....	15
4.6.1	VFDR ziņošanas pienākumu piemērošana VFD, ko ne-ES struktūras noslēgušas ar filiālēm ES.....	15
4.6.2	Paziņojamo VFD noteikšana, kad tos noslēdz filiāles.....	15
4.7	NFC ziņojumi.....	17
4.8	Darbības veidi.....	17
4.8.1	Piemērojamie darbības veidi.....	17
4.8.2	Pilns momentuzņēmums vai daļējs ziņojums par grozījumiem VFD.....	17
4.8.3	Darbības veidu secība dažāda veida ziņojumiem.....	18
4.9	Savlaicīga paziņošana par VFD noslēgšanu, grozīšanu un izbeigšanu.....	22
4.9.1	VFD noslēgšana.....	22
4.9.2	VFD grozīšana un labošana.....	22

4.9.3	Nodrošinājuma informācijas atjauninājumi .....	23
4.9.4	Novērtējuma, drošības rezerves un atkalizmantošanas atjauninājumi .....	24
4.9.5	VFD izbeigšana .....	24
4.9.6	Pārskats par ziņošanas termiņiem atkarībā no ziņojuma veida un darbības veida .....	25
4.10	Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem .....	26
4.11	CVD dalībnieka identifikācija .....	33
4.12	Darījumu partnera puses noteikšana .....	33
4.12.1	Vispārīgs gadījums .....	33
4.12.2	CDP tīrvērtētie VFD .....	33
4.12.3	Ziņošana par nenodrošinātu vērtspapīru aizdevumu/ aizņēmumu .....	33
4.12.4	Darījumu partnera puses paziņošana neto riska darījuma nodrošināšanas gadījumā .....	34
4.13	Cenas un vērtības lauki .....	34
4.13.1	Novērtēšanas termiņi .....	34
4.13.2	Aprēķina metode novērtējumos .....	34
4.14	CFI koda paziņošana vērtspapīram, kuru izmanto kā nodrošinājumu .....	35
4.15	Atlikšana .....	35
4.16	UDI izveide un struktūra .....	35
4.17	Saņēmēju identificēšana un paziņošana .....	37
4.18	Vērtspapīru emitenta un vērtspapīru identifikācija .....	37
4.19	Procedūra, kad darījumu partnerim tiek veikta korporatīva darbība .....	38
4.20	Ziņošana pakāpeniskas ieviešanas periodā .....	39
5	VFDR lauku tabulas .....	39
5.1	Darījumu partnera dati .....	41
	Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITs management company delegates reporting to a third party .....	43
	Non-cleared SFTs concluded by AIF .....	43
	Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced .....	43
5.1.1	Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp galvenajiem uzņēmumiem .....	43
5.1.2	Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp filiālēm .....	45
5.1.3	Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD ar saņēmējiem .....	47
5.1.4	Ne-tīrvērtēti VFD ar mākleri (brokeriem), veicot norēķinus ar turētājbanku ...	48
5.1.5	Ne-tīrvērtēts VFD ar mākleri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi .....	50

5.1.6	Ne-tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai.....	52
5.1.7	Tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi .....	54
5.1.8	Tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai.....	56
5.1.9	Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds.....	58
5.1.10	Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds, un PVKIU apsaimniekošanas uzņēmums deleģē ziņošanu trešai personai.....	60
5.1.11	Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis AIF fonds.....	61
5.1.12	Ne-tīrvērtēts VFD, kura līdzekļu portfeļa pārvaldīšana ir nodota ārpakalpojumā	63
5.2	Aizdevumu un nodrošinājuma dati.....	65
5.2.1	Ziņošana par darbības veidiem darījuma līmenī un pozīcijas līmenī.....	65
5.3	Aizdevuma dati.....	76
5.3.1	Notikuma datuma paziņošana .....	76
5.3.2	Tīrvērtēta/ ne-tīrvērtēta VFD paziņošana.....	76
5.3.3	Tirdzniecības vieta .....	83
5.3.4	Jumta līguma iedaļa .....	83
5.3.5	Darījuma noslēgšana un uzsākšana.....	86
5.3.6	VFD termiņš .....	87
5.3.7	Izbeigšanas iespējamība.....	89
5.3.8	Vispārīgie un īpašie nodrošinājuma mehānismi.....	89
5.3.9	Fiksētas vai mainīgas likmes.....	92
5.3.10	Repo darījumi un BSB/SBB pamatsummas.....	96
5.3.11	Aizdevuma puse, aizdodot vērtspapīrus .....	96
5.3.12	Vērtspapīri.....	97
5.3.13	VFD, kas saistīts ar precēm — preču aizdevums .....	102
5.3.14	Skaidras naudas atlaide SLB darījumos .....	104
5.3.15	SLB darījumi ar noteiktu maksu — bezskaidras naudas nodrošinājuma SLB, naudas kopfonda SLB un nenodrošināts SLB .....	105
5.3.16	Maržinālā aizdevuma summa un īstermiņa tirgus vērtība .....	106
5.4	Dati par nodrošinājumu .....	109
5.4.1	Ziņošana par SLB nodrošināšanu .....	109
5.4.2	Nodrošināšana .....	110
5.4.3	Naudas nodrošinājums.....	117

5.4.4	Ziņošana, ja nodrošinājums ir nulle .....	118
5.4.5	Vērtspāīra nodrošinājuma lauki .....	118
5.4.6	Mainīgā drošības rezerve darījuma līmenī tiem VFD, kas nav centralizēti tīrvērtēti .....	129
5.4.7	Mainīgā drošības rezerve VFD, kas nav centralizēti tīrvērtēti, ja nodrošināšana tiek veikta neto riska darījumam .....	138
5.4.8	Iepriekš apmaksāts nodrošinājums SLB darījumiem .....	179
5.4.9	Tīrvērtētu darījumu portfelis.....	181
5.5	Dati par drošības rezervi .....	181
5.5.1	CDP darbojas starp diviem darījumu partneriem, kuri ir tīrvērtes dalībnieki .....	181
5.5.2	CDP darbojas starp diviem darījumu partneriem, kuri nav tīrvērtes dalībnieki .....	182
5.5.3	Informācijas par drošības rezervi paziņošana.....	182
5.6	Atkalizmantošanas dati, naudas atkalieguldīšana un finansējuma avoti .....	184
5.6.1	Nodrošinājuma atkalizmantošana.....	184
5.6.2	Naudas nodrošinājuma atkalieguldīšana .....	191
5.6.3	Nulles līmeņa bezskaidras naudas nodrošinājuma atkalizmantošana un skaidras naudas atkalieguldīšana.....	198
5.6.4	Finansējuma avoti .....	199
6	Atgriezeniskā saite noraidījuma gadījumā .....	200
7	Atgriezeniskā saite saskaņošanas gadījumā .....	203
8	Trūkst atgriezeniskās saites par nodrošinājumu .....	205
9	Kā iesniegt informāciju iestādēm .....	206
9.1	Termiņi datu pieejamības iestatīšanai .....	206
9.2	Darbības mehānismi attiecībā uz piekļuvi datiem .....	206

# 1 Normatīvās atsauces, saīsinājumi un definīcijas

## Normatīvās atsauces

<i>AIFPD</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2011/61/ES (2011. gada 8. jūnijs) par alternatīvo ieguldījumu fondu pārvaldniekiem (AIFP)
<i>ETIR</i>	Eiropas tirgus infrastruktūru regula — Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 648/2012 par ārpusbiržas atvasinātajiem instrumentiem, centrālajiem darījumu partneriem un darījumu reģistriem
<i>FITR</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012
<i>Hipotekārās kredītēšanas direktīva</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2014/17/ES (2014. gada 4. februāris) par patērētāju kredītlīgumiem saistībā ar mājokļa nekustamo īpašumu un ar ko groza Direktīvas 2008/48/EK un 2013/36/ES un Regulu (ES) Nr. 1093/2010
<i>ĪTS par ziņošanu</i>	Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2019/363 (2018. gada 13. decembris), ar ko nosaka Īstenošanas tehniskos standartus attiecībā uz darījumu reģistriem saskaņā ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2015/2365 iesniedzamo ziņojumu par vērtspapīru finansēšanas darījumu (VFD) datiem formātu un sniegšanas biežumu un ar ko groza Komisijas Īstenošanas regulu (ES) Nr. 1247/2012 attiecībā uz ziņojumu kodu izmantošanu ziņojumos par atvasināto instrumentu līgumiem
<i>MAR</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 596/2014 (2014. gada 16. aprīlis) par tirgus ļaunprātīgu izmantošanu (tirgus ļaunprātīgas izmantošanas regula).
<i>Nodrošinājuma direktīva</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2002/47/EK (2002. gada 6. jūnijs) par finanšu nodrošinājuma līgumiem
<i>NTSR</i>	Regula (ES) Nr. 1333/2014 par naudas tirgu statistiku
<i>Patēriņa kredītu direktīva</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2008/48/EK (2008. gada 23. aprīlis) par patēriņa kredītlīgumiem un ar ko atceļ Padomes Direktīvu 87/102/EEK
<i>PVKIU</i>	Eiropas Parlamenta un Padomes 2009. gada 13. jūlija Direktīva 2009/65/EK par normatīvo un administratīvo aktu



koordināciju attiecībā uz pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmumiem (PVKIU)

*REMIT*

Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 1227/2011 (2011. gada 25. oktobris) par enerģijas vairumtirgus integritāti un pārredzamību

*RTS par datu pārbaudi*

Komisijas Deleģētā regula (ES) 2019/358 (2018. gada 13. decembris), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2015/2365 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par vērtspapīru finansēšanas darījumu (VFD) datu vākšanu, pārbaudīšanu, apkopošanu, salīdzināšanu un publicēšanu, ko veic darījumu reģistri

*RTS par piekļuvi datiem*

Komisijas Deleģētā regula (ES) 2019/357 (2018. gada 13. decembris), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2015/2365 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par piekļuvi darījumu reģistros glabātiem vērtspapīru finansēšanas darījumu (VFD) datiem

*RTS par ziņošanu*

Komisijas Deleģētā regula (ES) 2019/356 (2018. gada 13. decembris), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) 2015/2365 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par darījumu reģistriem iesniedzamiem vērtspapīru finansēšanas darījumu datiem

*TS*

RTS par ziņošanu (Komisijas Deleģētā regula (ES) 2019/356) un ĪTS par ziņošanu (Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2019/363)

*VFDR*

Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) 2015/2365 (2015. gada 25. novembris) par vērtspapīru finansēšanas darījumu un atkalizmantošanas pārredzamību un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 — turpmāk arī "regula"

## **2 Darbības joma**

### **Kam paredzētas šīs pamatnostādnes?**

1. Šīs pamatnostādnes ir paredzētas VFD darījumu partneriem, kā noteikts VFDR 3. panta 2. punktā, darījumu reģistriem, kā noteikts VFDR 3. panta 1. punktā, un kompetentajām iestādēm.

### **Ko nosaka šīs pamatnostādnes?**

2. Šīs pamatnostādnes nosaka VFD ziņošanas pienākumu, kā paredzēts VFDR 4. pantā, darījumu reģistru pienākumus saskaņā ar VFDR 5. panta 7. punktu un 12. pantu, kā arī ziņošanas sākuma datumu, kā noteikts VFDR 33. panta 2. punktā.

### **Kad šīs pamatnostādnes stājas spēkā?**

3. Šīs pamatnostādnes piemēro no nākamās dienas pēc to publicēšanas ESMA tīmekļa vietnē vai no dienas, kad piemēro attiecīgos noteikumus struktūrām, kā noteikts VFDR 33. panta 2. punktā, atkarībā no tā, kurš datums iestājas vēlāk.
4. Darījumu partneri, par ziņošanu atbildīgās struktūras un ziņojumu iesniedzējas struktūras tiek aicinātas piemērot šīs pamatnostādnes no pirmās dienas, kad stāsies spēkā attiecīgais ziņošanas pienākums saskaņā ar VFDR 33. panta 2. punkta a) apakšpunktu.

## **3 Mērķis**

5. Šīs pamatnostādnes ir sagatavotas saskaņā ar ESMA regulas 16. panta 1. punktu. Šo pamatnostādņu mērķis ir izskaidrot vairākus VFDR noteikumus un sniegt praktiskus norādījumus par dažu šo noteikumu īstenošanu. Pamatnostādnes palīdzēs samazināt izmaksas visā ziņošanas ķēdē — darījumu partneriem, kas paziņo datus, darījumu reģistriem, kas ievieš procedūras, lai pārbaudītu datu pilnīgumu un pareizību, un iestādēm, kas minētas VFDR 12. panta 2. punktā un izmanto šos datus finanšu stabilitātes risku uzraudzībai. Pamatnostādnes izskaidro šādus aspektus:
  - a. ziņošanas sākuma datums, ja tas iekrīt brīvdienā;
  - b. paziņojamo VFD skaits;
  - c. ziņojuma lauku aizpildīšana dažādiem VFD veidiem;
  - d. metode, ko izmanto VFD nodrošinājuma sasaistei ar VFD aizdevumiem;
  - e. ziņojuma lauku aizpildīšana, sniedzot datus par drošības rezervi;
  - f. ziņojuma lauku aizpildīšana, sniedzot atkalizmantošanas, atkalieguldīšanas un finansējuma avotu datus;
  - g. darījumu reģistra sagatavota atgriezeniskā saite un tās turpmāka pārvaldīšana, ko veic darījumu partneri, proti, i) paziņoto datu noraidīšanas gadījumos un ii) saskaņošanas pārtraukumu gadījumos; un
  - h. piekļuve datiem, ko iestādēm nodrošina darījumu reģistri.



## 4 Vispārīgi principi

### 4.1 Ziņošanas sākuma datums

6. Ziņošanas pienākumu saskaņā ar VFDR 4. panta 1. punktu piemēro atbilstoši VFDR 33. panta 2. punkta a) apakšpunkta i) daļā noteiktajam piemērošanas datumam. Pienākuma pirmā posma piemērošana sākas 2020. gada 11. aprīlī, kas ir sestdiena. Saskaņā ar VFDR 4. panta 1. punktu darījumu partneriem jāizpilda ziņošanas pienākums ne vēlāk kā nākamajā darbadienā pēc darījuma noslēgšanas, grozīšanas vai izbeigšanas.
7. Struktūrām, kas minētas VFDR 33. panta 2. punkta a) apakšpunkta i) daļā un veic uzņēmējdarbību ES dalībvalstīs, kurās 13. aprīlis nav svētku diena, t. i., tā ir darbadiena, līdz 2020. gada 13. aprīlim jāsāk ziņot par VFD, kas noslēgti 2020. gada 11. aprīlī vai pēc tā.
8. Struktūrām, kas minētas VFDR 33. panta 2. punkta a) apakšpunkta i) daļā un veic uzņēmējdarbību ES dalībvalstīs, kurās 13. aprīlis ir svētku diena, t. i., tā nav darbadiena, līdz 2020. gada 14. aprīlim jāsāk ziņot par VFD, kas noslēgti 2020. gada 11. aprīlī vai pēc tā.
9. Tāda pati metode jāizmanto attiecībā uz pārējiem ziņošanas pienākuma piemērošanas datumiem.

### 4.2 Paziņojamo VFD skaita noteikšana

10. Saskaņā ar ĪTS par ziņošanu 1. panta 1. punktu darījumu partneriem jāiesniedz VFD ziņojumi, izmantojot vienotu elektronisku un mašīnlasāmu veidlapu un vienotu XML veidni saskaņā ar ISO 20022 metodiku. Lai to atvieglotu, šajās pamatnostādnēs ir iekļauts attiecīgais XSD komponents, kas piemērojams dažādiem izmantošanas gadījumiem.

#### 4.2.1 Tirgus darījumi, uz kuriem neattiecas VFD definīcija

11. Uz šādiem darījumiem neattiecas VFD definīcija, un par tiem nav jāziņo saskaņā ar VFDR:
  - a. privātpersonu kreditēšana, ko reglamentē tiesību akti par patēriņa kredītiem;
  - b. privātbanku aizdevumi un lombarda aizdevumi, kas nav saistīti ar vērtspapīru finansēšanu;
  - c. sindicētie aizdevumi un citi korporatīvie aizdevumi komerciāliem mērķiem;
  - d. depozitāriju overdrafta līnijas un centrālo darījumu partneru (CDP) līnijas aizdevumiem vienas dienas robežās;
  - e. dienas kredīts/ overdrafts kļūmes novēršanai;
  - f. centrālās bankas automātiskais nodrošinājums;
  - g. atteikšanās un uzņemšanās izpildes un tīrvērtes ķēdē;
  - h. preču darījumi, kas noslēgti pamatdarbības un/vai rūpnieciskām vajadzībām;
  - i. darījumi, kas saistīti ar emisijas kvotām.

#### 4.2.2 Aspekti, kas saistīti ar jebkura veida VFD

12. VFD puse, kas darbojas savā vārdā, slēdzot darījumu uz sava rēķina, jāsauc par VFD partneri.
13. Struktūra, kas atvieglo, organizē vai kā citādi piedalās, bet ne savā vārdā un ne uz sava rēķina, VFD noslēgšanā vai nu saistībā ar aizdevumu, vai nodrošinājumu un kas darbojas klienta vārdā, nav jāsauc par darījuma partneri, bet attiecīgi par māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju, trīspusēju pārstāvi vai CVD dalībnieku. Vienai struktūrai VFD var būt vairākas funkcijas. Tas, kā konkrēti ierakstīt darījumu partneru datus, ir aprakstīts 5.1. punktā.
14. Tādēļ darījumu partneru pienākums ir norādīt, kāda veida VFD viņi ir noslēguši. Tāpat, kā norādīts RTS par ziņošanu 1. pielikumā un šā dokumenta 5.2. punktā, ne visi lauki attiecas uz visiem VFD, tādēļ darījumu partneriem bez šaubām ir jāvienojas par noslēgtā VFD veidu.
15. Par VFD ir jāziņo, ja tam ir divi darījumu partneri vai ja viena no VFD pusēm ir fiziska persona, kas nav uzņēmums, bet otra ir darījumu partneris, kas noteikts VFDR. Nevienam VFD nav vairāk par vienu pāri darījumu partneru. Ja aizdevumi tiek sadalīti starp diviem vai vairākiem nodrošinājuma ņēmējiem un diviem vai vairākiem nodrošinājuma sniedzējiem, VFD definē attiecībā uz katru vērtspapīru, skaidras naudas vai preču nodrošināto aizdevumu starp diviem darījumu partneriem.
16. Ja ir izpildīti 12. punkta nosacījumi, ieguldījumu fondus neatkarīgi no to juridiskā statusa uzskata par VFD darījumu partneriem. Konkrēti, apakšfondu gadījumā, līdzīgi tam, kā paredzēts ETIR, tiem parasti ir juridiskās personas identifikators (LEI). Par apakšfondiem ar LEI jāziņo kā par atsevišķiem darījumu partneriem. Attiecīgajā informācijā par aizdevumu un nodrošinājumu jāsniedz atsauce uz šā apakšfonda noslēgtajiem VFD. Ja apakšfonds nav VFD dalībnieks, jāpiemēro 4.17. punkta noteikumi.
17. Attiecībā uz VFD, kam ir veikta tīrvērte, katrs VFD, kas noslēgts starp centrālo darījumu partneri, tīrvērtes dalībniekiem, šo dalībnieku klientiem un tā tālāk, ir atsevišķs VFD, un par to jāziņo, norādot atšķirīgu unikālo darījuma identifikatoru (UDI). Ja VFD tiek noslēgts tirdzniecības vietā un tajā pašā dienā tam tiek veikta tīrvērte, kā paredzēts RTS par ziņošanu 2. panta 2. punktā, par to ziņo jau pēc tīrvērtes, t. i., nav jāziņo par starpposma atteikšanos un uzņemšanos. Papildu informāciju par tīrvērtēto VFD paziņošanu skatīt 4.3. punktā.
18. Turklāt attiecībā uz VFD kļūmes novēršanai CVD kā darījuma partneri jānorāda attiecīgie CVD dalībnieki, nevis viņu klienti. Tā jārikojas arī gadījumā, ja VFD tiek noslēgts, izmantojot vispārējo kontu.
19. Tādējādi, izņemot darījumus, kas iekļauti VFDR 2. panta 3. punktā, un darījumus, kas minēti 4.2.1. punktā, par visiem citiem VFD jāziņo tā, kā norādīts šo pamatnostādņu nākamajā iedaļā.
20. Jāatzīmē, ka par VFD, kas minēti 2. panta 3. punktā, jāziņo saskaņā ar Regulu Nr. 600/2014.

#### 4.2.3 Aspekti, kas saistīti ar repo darījumiem

21. Ja aizdevumi tiek nodrošināti vairāk nekā vienā valūtā, katrs no tiem veido atsevišķu VFD un par tiem jāziņo, norādot atsevišķus UDI. Ziņojumi par katru repo darījumu jāsniedz saskaņā ar repo darījumu ziņošanas vispārīgajiem principiem:
  - a. attiecībā uz katru atsevišķo valūtu norāda piemērojamās pamatsummas un UDI, kā arī atsevišķos nodrošinājuma komponentus, ja tādi ir; un
  - b. norāda attiecīgu nodrošinājumu katram neto riska darījumam, t. i., nodrošinājumu, kas sedz repo darījumu, bet nav konkrēti piesaistīts nevienam no šiem darījumiem, un pārlicinās, ka uz šo nodrošinājumu attiecīgajos laukos ir izveidotas saites.
22. Ja atpirkšanas cenu izsaka citā valūtā, nevis tajā, kurā izteikta pirkuma cena, bet tā tomēr attiecas uz to pašu repo darījumu, tad tālākās daļas valūta jākonvertē tuvākās daļas valūtā, lai paziņotu būtisko informāciju par cenu un pamatsummām. Skatiet pamatnostādnes par valūtas kursu piemērošanu, paziņojot tirgus vērtības, 4.13.1. punktā, lai pārlicinātos, ka šajā laukā tiek ierakstīts pareizs skaitlis.
23. Ja repo darījuma nodrošinājums tiek sniegts citā veidā, tomēr paliekot nodrošinājuma līguma ietvaros, kā norādīts Nodrošinājuma direktīvā, darījumu partneriem par to jāprojām jāziņo kā par repo darījumu. Par repo darījumiem, kas noslēgti saskaņā ar citu jurisdikciju noteikumiem, piemēram, par Ģentes repo darījumiem, jāziņo kā par tādiem, sniedzot pilnīgu un precīzu informāciju saskaņā ar TS par ziņošanu.
24. Uz repo darījumiem un reversajiem repo darījumiem, ko CDP noslēdz, lai ieguldītu i) paša aktīvus likviditātes uzturēšanai vai ii) tīrvērtes dalībnieku aktīvus, kas norādīti kā drošības rezerve, attiecas ziņošanas pienākums saskaņā ar VFDR 4. pantu.
25. Par repo darījumiem un reversajiem repo darījumiem jāziņo, izmantojot ISO 20022 XML veidni, kas piemērojama repo darījumiem.

#### 4.2.4 Aspekti, kas attiecas uz pirkuma–atpārdevuma un pārdevuma–atpirkuma (BSB/SBB) darījumiem

26. Noteiktus BSB/SBB reglamentē divpusēji vai jumta līgumi. Tomēr konkrētie pielikumi, kas attiecas uz šiem VFD, atšķiras no tiem, kas attiecas uz repo darījumiem un reversajiem repo darījumiem. Nav šaubu, ka BSB/SBB ir viens no noslēgto VFD veidiem.
27. Ja BSB/SBB reglamentē divpusējs vai jumta līgums, vai jumta līguma pielikums, par šo līgumu jāziņo attiecīgajos laukos, proti, 2. tabulas 9.–11. laukā par aizdevuma un nodrošinājuma datiem.
28. Darījumu partneriem jācenšas precīzi vienādā veidā ziņot par jumta līgumiem, kas nav iekļauti ĪTS par ziņošanu. Arī attiecībā uz jumta līgumu — laukā par jumta līgumu jāziņo, izmantojot redakciju, kas piemērojama noslēdzamajam VFD.
29. Ja darījumu partneri konstatē, ka par dažiem BSB/SBB veidiem labāk ziņot, izmantojot repo darījumu veidni, un ja abi darījumu partneri par to vienojas, jāizmanto repo darījumu veidne, ziņojot par attiecīgajiem VFD.
30. Par BSB/SBB jāziņo, izmantojot ISO 20022 XML veidni, kas piemērojama BSB/SBB darījumiem.

#### 4.2.5 Aspekti, kas saistīti ar vērtspapīru aizdošanu un aizņemšanos (SLB)

31. Pēc definīcijas SLB darījuma noslēgšana ir saistīta ar aizdevēja vērtspapīru pārskaitīšanu aizņēmējam. SLB pārskaitījumā nevar izmantot vairāk kā tikai vienu ISIN numuru. Ja piesaistes procesā, ko veic trešās personas struktūras, piemēram, koordinējošie aizdevēji, pārskaitījumos starp noteiktu darījumu partneru pāri ir jāizmanto vairāk nekā viens ISIN, par katru ISIN jāziņo kā par atšķirīgu VFD.
32. Tā kā VFDR 4. panta 1. punkts paredz ziņot par VFD noslēgšanu, grozīšanu un izbeigšanu ne vēlāk kā nākamajā darbadienā, ir jāziņo par visiem noslēgtajiem VFD. Tas attiecas uz visiem izveidotajiem VFD, pat ja ir iespējams, ka tie netiks noslēgti.
33. Dažos iesniegtajos scenārijos netika ņemti vērā noteikta veida aktīvu pārvaldītāji. Tas ietver fondus, kuri apvieno vērtspapīrus aktīvu portfelī un var tos aizdot. Šie fondi izmanto tirdzniecības māklerus (brokerus), kuri darbojas kā pārstāvji un aizdod vērtspapīrus noteiktā daudzumā no šo fondu aktīvu portfeļa. Tiks apstiprināti tiešie darījumi starp darījumu partneri un šo portfelī. Dienas beigās tiek veikta galīgā piesaiste, un katram fondam, kas piedalās portfelī, tiek nosūtīti individuāli apstiprinājumi. Informācija tiek nosūtīta arī darījumu partnerim, un norēķini notiek, veicot vienotu pārskaitījumu no kopējā depozitārija visiem attiecīgajiem fondiem. Šajā konkrētajā gadījumā un ievērojot vispārīgo principu, kas iekļauts 15. punktā, darījumu partneriem jāziņo darījumu reģistriem par katru darījumu partneru pāri un katru ISIN kā par atsevišķu VFD.
34. Ja vērtspapīri tiek aizdoti CDP sistēmā ar aktīvu portfelī, nav iespējams ziņot par dienas cikla aktivitātēm, ja aizņēmējam un aizdevējam dienas beigās tiek piesaistītas tikai jaunās neto aizdevuma pozīcijas. Tādēļ CDP sistēmā ir jāziņo par dienas cikla aizdevumiem, lai gan nodrošinājums tiem varētu arī nebūt vajadzīgs. Par nodrošinājumu jāziņo visu citu SLB gadījumā, ja lauks "Nenodrošināta SL atzīme" (2.72. punktā) tiek aizpildīts ar "nepareizs", ieskaitot apmaksāto jauno neto aizdevumu, kas jānorāda darījuma ziņojumā (S+1 dienā).
35. Par SLB jāziņo, izmantojot ISO 20022 XML veidni, kas piemērojama SLB darījumiem.
36. Par SLB darījumiem skaidrā naudā, kas zināmi arī kā "reversie vērtspapīru aizdevumi", jāziņo kā par repo darījumiem. Ja par SLB darījumiem skaidrā naudā ziņo, izmantojot repo darījuma laukus, jāņem vērā, ka jumta līguma veidam jāatbilst attiecīgajam jumta līgumam, piemēram, GMSLA.

#### 4.2.6 Aspekti, kas saistīti ar precu VFD

37. VFD izpildei jābūt strukturētai tā, lai faktiskais īpašnieks nezaudētu savas ekonomiskās īpašumtiesības uz precēm un neuzņemtos arī jaunus riskus preču tirgū.
38. Repo/ reversā repo darījumiem, kas saistīti ar precēm, ir raksturīga (atpirkšanas) līguma esamība. Preces var nodot, nododot tiešās īpašumtiesības, vai ķīlas veidā.
39. Tomēr attiecībā uz VFD, kuru joma ir saistīta ar precēm, ja pārdošanu un atpirkšanu nevar kvalificēt kā repo darījumu, tā vietā vajadzētu norādīt BSB darījumu.

40. Preču aizdošanas un aizņemšanās (SLB) darījumā nodrošinājuma ņēmējs ir tā puse, kura preces aizdod, un nodrošinājuma sniedzējs šīs preces aizņemas. Tā ir atšķirība no repo/ reversā repo un BSB/SBB darījumiem, kuros prece tiek uzskatīta par darījuma nodrošinājumu.
41. Ziņojot par VFD, kas saistīti ar precēm, papildus attiecīgajiem jumta līgumiem, darījumu partneriem jānovērtē arī tas, cik lielā mērā paziņojamais VFD, kas saistīts ar precēm, pēc sava veida var atbilst laukiem, kas piemērojami attiecīgajam VFD. Tas palīdzēs noteikt, vai darījums jāpaziņo kā preču aizdošanas vai aizņemšanās darījums, vai kā repo/ SBB vai reversā repo/ BSB darījums, kas nodrošināts ar precēm.
42. Turklāt visos VFD, kas definēti VFDR 3. panta 7.–10. punktā, izņemot maržinālos aizdevumus, tiek iekļauta atsauce uz preču iespējamo izmantošanu VFD ietvaros. BSB/SBB ierobežo preču izmantošanu pirkšanai un turpmākai pārdošanai ar abiem darījumu partneriem (bez tirgus starpnieka), turpretim preču aizdošanas un aizņemšanās darījumi un repo darījumi pieļauj gan īpašumtiesību nodošanas, gan ķīlas mehānismus. Tādēļ darījumu partneriem attiecīgi jāieraksta nodrošinājuma mehānisma veids 2.20. laukā “Nodrošinājuma sniegšanai izmantotā metode”.
43. VFD, kas saistīti ar precēm, dažkārt var ietilpt sarežģītākās struktūrās, tostarp izmantojot atvasinātos instrumentus, piemēram, nākotnes līgumus un iespējas līgumus. Jāziņo ir tikai par tām kopējās struktūras daļām, kas ir VFD. Atvasinātie instrumenti, ko izmanto šādās struktūrās, var būt paziņojami saskaņā ar ETIR un/vai FITD, un/vai REMIT.
44. Attiecībā uz to, ko nozīmē līdzvērtīgas preces un aizvietotas preces, ESMA precizē:
  - a. līdzvērtīgas preces ir tāda paša veida preces ar līdzīgām īpašībām un/vai specifikācijām, kas var aizstāt oriģinālās preces atgriešanas posmā, ja par to ir panākta vienošanās līgumā;
  - b. aizvietotas preces ir preces, kuras ir iekļātas kā nodrošinājums, aizstājot tās preces, kas sākotnēji tika iekļātas kā nodrošinājums tajā pašā darījumā.

#### 4.2.6.1 VFD, kas saistīti ar enerģiju

45. Darījums (piemēram, gāzes pirkšana–atpakaļpārdošana apgabalos ar (alternatīviem) finansēšanas mērķiem) var būt paziņojams REMIT darījums ar ziņošanas termiņu T+30 dienā un vienlaikus — arī VFD, kas paziņojams līdz T+1 dienai.
46. Tādēļ, ja šie darījumu veidi ir pietiekami skaidri, lai tos nepārprotami klasificētu kā VFD, ko izmanto preču finansēšanai, par tiem jāziņo atbilstīgi attiecīgajai ziņojuma veidnei.

#### 4.2.7 Aspekti, kas saistīti ar maržinālajiem aizdevumiem

47. Paredzams, ka starp katru darījumu partneru pāri noteiktā laika brīdī pastāv viens un tikai viens maržinālā aizdevuma darījums, izņemot gadījumus, kad struktūras ir līgumā vienojušās par vairāk nekā vienu pamatvalūtu un maržinālie aizdevumi tiek noteikti attiecībā uz katru no tiem, un šādā gadījumā vajadzētu būt maržināla aizdevuma darījumam katrai pamatvalūtai. Šāds VFD attieksies uz jebkuru maržinālo aizdevumu vai īstermiņa tirgus vērtību pamatvalūtā.

48. UDI identifikatori maržinālam aizdevumam būtu jārada tikai tad, kad šī līnija ir izmantota vismaz vienu reizi. Gadījumos, kad ir parakstīts līgums ar specializēto māklēri (brokeri), bet līnija vēl nav izmantota, ziņojums nav vajadzīgs, jo vēl nav noslēgts VFD.
49. Ja kādā brīdī gan maržinālais aizdevums, gan īstermiņa tirgus vērtība nokrīt līdz nullei, t. i., netiek pagarināts skaidras naudas vai vērtspapīru kredīts, specializētā māklēra (brokera) turētais klienta nodrošinājums vairs nesniedz nodrošinājumu VFD riska darījumam. Tas tiek turēts citām ne-VFD saistībām. Specializētajam māklērim (brokerim) un klientam i) jāpārtrauc ziņot par nodrošinājumu līdz brīdim, kad atkal eksistēs maržinālais aizdevums vai īstermiņa tirgus vērtības riska darījums, vai ii) jāziņo par skaidras naudas nodrošinājumu nulles līmenī, lai norādītu, ka nodrošinājuma nav.
50. Par darījumu nav jāziņo kā par darbības veidu "ETRM", bet drīzāk kā par darbības veidu "MODI". Šajā gadījumā ir paredzēts saņemt arī nodrošinājuma informācijas atjaunināšanas ziņojumu (COLU), kas norāda nulli kā skaidras naudas nodrošinājuma vērtību, lai nepieļautu nepareizas informācijas sniegšanu par izmantoto nodrošinājumu. Par to, kā ziņot par nodrošinājumu nulles līmenī, skatīt 5.4.4. punktu.
51. Maržinālo aizdevumu gadījumā darījumu partneriem nav jāziņo par nodrošinājuma komponentiem, kas nav ne vērtspapīri, ne skaidra nauda.
52. Paziņojot klienta īstermiņa tirgus vērtību, nevajadzētu izmantot specializētā māklēra (brokera) atzītos grāmatvedības datus (t. i., darījuma datumu vai grāmatvedības norēķinu datumu) (SGS 39.38 "Finanšu instrumenti: atzīšana un novērtēšana"). Par īstermiņa tirgus vērtību jāziņo tādā pašā veidā, kā tiek ziņots par aizdevuma atmaksu un nodrošinājumu. Tādējādi darījumu partneriem jāaprēķina īstermiņa tirgus vērtība, pamatojoties uz plānoto norēķinu datumu un vērtspapīriem, kurus paredzēts izsniegt.
53. Turklāt, ja specializētā māklēra (brokera) klienta portfelis neietver vērtspapīru tirdzniecību, ziņojumiem par kredīta pagarināšanu šiem klientiem no VFDR viedokļa nav vērtības, un no tiem jāizvairās, lai novērstu liela apjoma nevajadzīgas informācijas vākšanu.

### 4.3 Ziņošana par CDP tīrvērtētiem VFD

54. Ziņojumi pozīciju līmenī ir piemērojami CDP tīrvērtētiem VFD, tie ir fakultatīvi un papildina darījuma līmeņa ziņojumus. Ziņojumus pozīciju līmenī var iesniegt, izpildot vairākus nosacījumus<sup>1</sup>.
  - a. Juridiskais mehānisms ir tāds, ka risks ir pozīcijas līmenī, visi tirdzniecības pārskati attiecas uz produktiem, kas ir savstarpēji aizstājami, un atsevišķie darījumi ir aizstāti ar pozīciju. Šajā gadījumā pēc atsevišķo darījumu savstarpējās ieskaites notiek novācija, ieskaitītā pozīcija izraisa jaunu līgumu, un tam tiek izveidots jauns UDI identifikators. Tā var notikt, piemēram, darījumos starp tīrvērtes dalībnieku un centrālo darījumu partneri.
  - b. Par sākotnējiem tirdzniecības darījumiem, t. i., darījuma līmenī, ir ziņots pareizi. Nav atļauts paziņot tikai pozīcijas.

---

<sup>1</sup> Skatīt Konsultāciju dokumenta par pamatnostādņēm ziņošanai saskaņā ar VFDR 84. punktu.



- c. Par citiem notikumiem, kas ietekmē kopējos laukus pozīcijas ziņojumā, tiek ziņots atsevišķi.
  - d. Sākotnējie darījuma ziņojumi (sk. iepriekš b) apakšpunktu) un ziņojumi par citiem notikumiem (sk. iepriekš c) apakšpunktu) attiecīgā gadījumā ir sasnieguši atbilstošu "darbmūža beigu stāvokli". Tas jāpanāk, nosūtot pirmstermiņa izbeigšanas ziņojumus un pēc tam paziņojot neto pozīciju kā jaunu pozīciju vai kā atjauninājumu esošajai pozīcijai.
  - e. Pozīcijas ziņojums jā sagatavo pareizi, aizpildot visus piemērojamus laukus ar darījumu partnerim raksturīgiem un darījuma datiem un, ja nepieciešams, norādot drošības rezervi un aizpildot nodrošinājuma lauku atkārtotas izmantošanas tabulu.
55. Ja šie nosacījumi ir izpildīti, ziņojumus par turpmākiem atjauninājumiem, tostarp novērtējuma atjauninājumiem, nodrošinājuma informācijas atjauninājumiem un citiem grozījumiem un dzīves cikla notikumiem, var iekļaut pozīcijas ziņojumā (kā grozījumus utt., saglabājot tādu pašu UDI lielumu CDP tīrvērtētā pozīcijā), nevis ziņojumos par sākotnējiem darījumiem/ notikumiem.
56. Pozīcijas līmeņa ziņojumam jāpiešķir atsevišķs UDI, kas ir pastāvīgs šīs pozīcijas identifikators, t. i., tas nemainās, grozot pozīciju.
57. Atkārtoti jānorāda, ka, veicot pozīcijas līmeņa ziņošanu, par tīrvērtētiem VFD vispirms jāziņo darījuma līmenī, norādot darbības veidu "POSC" (pat ja darījums tiek tīrvērtēts tajā pašā dienā), un tikai pēc tam dzīves cikla notikumus var paziņot pozīcijas līmenī. Skatīt 5.2.1. punktā iekļauto scenāriju, kas ilustrē nepieciešamās darbības, ziņojot pozīcijas līmenī.

#### **4.4 Atbildības sadale saskaņā ar VFDR 4. panta 3. punktu**

##### **4.4.1 Vispārīgs gadījums**

58. NFC būtu jāinformē finanšu darījumu partneri (FC) par to, vai tie ir uzskatāmi par maziem NFC, kā arī jāinformē šie FC par jebkurām iespējamām statusa izmaiņām.

##### **4.4.2 Trešās valsts finanšu darījumu partneri (TC-FC)**

59. Gadījumos, kad Eiropas Komisija ir atzinusi konkrētās trešās valsts (TC) līdzvērtīgumu, ja VFD ir noslēgts starp trešās valsts FC ar filiāli Savienībā un NFC, kas ir MVU, un ja trešās valsts FC un NFC, kas ir MVU, ir izpildījuši minētās trešās valsts ziņošanas prasības, ne trešās valsts FC, ne NFC, kas ir MVU, nav jāziņo par VFD saskaņā ar VFDR.
60. Attiecībā uz VFD, kas noslēgti starp trešās valsts FC, uz kuriem neattiecas VFDR (t. i., uz kuriem neattiecas VFDR 2. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) daļa), un NFC, kas ir MVU, par šādiem VFD vai nu NFC, kas ir MVU, ir tieši jāziņo darījumu reģistram, vai arī tam kā citādi jāizmanto 4. panta 2. punktā paredzētā deleģēšanas iespēja.

#### 4.4.3 Fondi

61. Ja atbildības sadalījums saskaņā ar VFDR 4. panta 3. punktu nav piemērojams AIFP, t. i., uz AIFP nav attiecināms VFDR, par VFD paziņošanu darījumu reģistram atbild fonds.

### 4.5 Ziņošanas brīvprātīga deleģēšana

62. Ja ziņošana tiek deleģēta, deleģējošajam darījumu partnerim (uz kuru attiecas ziņošanas pienākums) laikus jāsniedz ziņojuma iesniedzējai struktūrai visa VFD informācija, un šis darījumu partneris ir atbildīgs par minētās informācijas pareizības nodrošināšanu. Vienlaikus ziņojuma iesniedzējai struktūrai jānodrošina, ka ziņojošie darījumu partneri tiek informēti par datiem, kas paziņoti viņu vārdā, par attiecīgajiem datu apstrādes rezultātiem darījumu reģistrā un par attiecīgajām ziņošanas vai datu kvalitātes problēmām, ja tādas rodas.

### 4.6 VFDR ziņošanas pienākumu piemērošana filiāļu noslēgtiem VFD

#### 4.6.1 VFDR ziņošanas pienākumu piemērošana VFD, ko ne-ES struktūras noslēgušas ar filiālēm ES

63. Saskaņā ar VFDR mērķi un atbilstoši ETIR, ESMA uzskata, ka termins “noslēgšana” jāsaprot kā tāds, kas ir saistīts ar darījuma partneri, t. i., to darījumu partneri, kurā VFD tiek reģistrēts.

#### 4.6.2 Paziņojamo VFD noteikšana, kad tos noslēdz filiāles

64. 1. tabula paskaidro, par ko jāziņo, atsaucoties uz ziņojošo darījumu partneru filiālēm.
65. Pēdējā aile “Paziņojams saskaņā ar VFDR” norāda, vai uz darījumu attiecas ziņošanas pienākums, kas paredzēts VFDR. Ja darījums nav paziņojams, par to nav jāziņo, neatkarīgi no darījumu partneru/ filiāļu atrašanās vietas. 1. tabulas sarkanajās rindās ir parādīti scenāriji, par kuriem nekad nav jāziņo saskaņā ar VFDR.
66. Ir svarīgi izprast, ka attiecībā uz dažiem scenārijiem darījumu partnera ziņošanas pienākuma esamība nenozīmē, ka par VFD ir jāziņo, un otrādi, kā paskaidrots 1. tabulā. Piemēram, par darījumiem, kas noslēgti starp vienas un tās pašas juridiskās personas divām filiālēm, pat ja darījumu partnerim (kas apzīmēts ar 1. LEI) ir ziņošanas pienākums, nav jāziņo, kā norādīts pēdējā ailē. Iemesls ir tāds, ka šajā gadījumā nav divu darījumu partneru, bet gan viena un tā paša partnera divas daļas.
67. Pat ja filiālei ir LEI, 1.3. laukā “Ziņojošais darījumu partneris” un 1.11. laukā “Otrs darījumu partneris” jānorāda attiecīgā galvenā uzņēmuma LEI, turpretim informācija par attiecīgo filiāli ir jāsniedz 1.17. laukā “Ziņojošā darījumu partnera filiāle” un 1.8. laukā “Otra darījumu partnera filiāle”. 1.12. laukā “Otra darījumu partnera valsts” jāieraksta galvenā uzņēmuma, nevis filiāles, valsts kods.



## 1. tabula. Filiāļu ziņojumi

	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 NFC ziņojumi

68. ESMA atzīst, ka dažos scenārijos LEI identifikators var nebūt pieejams; tomēr šāds scenārijs neattiecas uz NFC, kas veic uzņēmējdarbību ES. Visām struktūrām, uz kurām attiecas VFDR, jāizmanto LEI, lai identificētu struktūras, kas minētas attiecīgajos datu laukos.
69. Ja VFD tiek noslēgts starp diviem NFC, abiem ir par to jāziņo darījumu reģistram, taču var izmantot arī iespēju saskaņā ar 4. panta 2. punktu deleģēt ziņošanu vienam no tiem vai trešai personai.

## 4.8 Darbības veidi

### 4.8.1 Piemērojamie darbības veidi

70. VFD darījumu partneriem jāziņo par VFD noslēgšanu, grozīšanu un izbeigšanu. Ja VFD informācija, kas ierakstīta datu laukos, nekādi nav mainījusies, darījumu partneriem nav vēlreiz jāpaziņo informācija par VFD.
71. Novērtējuma atjauninājumi jāpaziņo tikai tad, kad mainās vērtība tiem vērtspapīriem, kas ir aizdoti vai tiek izmantoti kā nodrošinājums.
72. Ziņojot par nodrošinājumu, darījumu partneriem nav jāziņo par visām nodrošinājuma izmaiņām dienas laikā, bet tikai par stāvokli dienas beigās.
73. Darbības veidi ir savstarpēji izslēdzoši. Ziņojumi par dažādiem darbības veidiem satur atšķirīgu informāciju iestādēm gan uzņēmējdarbības, gan datu pārvaldības aspektā. Tādēļ darījumu partneriem jācenšas norādīt pareizo darbības veidu.

### 4.8.2 Pilns momentuzņēmums vai daļējs ziņojums par grozījumiem VFD

74. Ja grozījumi attiecas uz VFD — gan dzīves cikla notikumiem, gan labojumiem — darījumu partneriem jāiesniedz ziņojumi, kas satur visus piemērojamus laukus, tostarp tos, kas nav grozīti, joprojām paredzot iespēju aizdevuma un nodrošinājuma datus paziņot atsevišķi.
75. Turklāt jāņem vērā, ka novērtēšanas, nodrošinājuma, drošības rezerves un atkalizmantošanas atjauninājumi ir dienas momentuzņēmuma ziņojumi, un tajos jāiekļauj visi attiecīgie lauki. Tā kā tie ir ikdienas ziņojumi, ir paredzams arī, ka katrs no šiem momentuzņēmuma ziņojumiem raksturo stāvokli dienas beigās, ņemot vērā visus attiecīgos grozījumus, kas notikuši dienas laikā. Līdz ar to un ņemot vērā ziņošanas termiņu līdz T+1 dienai, netiek paredzēts, ka darījumu partneris iesniegs korekcijas ziņojumu par nodrošinājumu, novērtējumu, drošības rezervi vai atkalizmantošanu par kārtējo dienu vai iepriekšējo darbadienu. Gluži otrādi, nodrošinājuma, novērtējuma, drošības rezerves vai atkalizmantošanas labojumi jāiesniedz tikai attiecībā uz vēsturiskajiem datiem, ja pēc paziņošanas termiņa tiek konstatēta kļūda paziņotajā informācijā.
76. Ja informācija attiecas uz darījuma aizdevuma daļu, ir jāziņo par visām izmaiņām, turklāt atsevišķi no aizdevuma datu labojumiem. Ja vienā un tajā pašā dienā notiek dažādas izmaiņas, par tām var ziņot vienā ziņojumā, ja tas precīzi raksturo visas izmaiņas.

77. Tas, kuri lauki ir nepieciešami katram ziņojuma veidam, tiek norādīts apstiprināšanas noteikumos.
78. Attiecībā uz dažiem laukiem, kas nav jāmaina (piemēram, “Izpildes laika spiedogs”), nav paredzams, ka darījumu reģistrs pārbaudīs, vai šo lauku saturs nav izmainīts, ja tiek ziņots par darbības veidu “MODI”, izņemot gadījumus, kad konkrētā lauka apstiprināšanas noteikumos ir norādīts citādi.

#### 4.8.3 Darbības veidu secība dažāda veida ziņojumiem

79. 2., 3. un 4. tabula sniedz informāciju par dažādām darbības veidu secības kombinācijām, kuras neaizliedz apstiprināšanas noteikumi<sup>2</sup>. Informācija, kas sniegta 2. tabulā, attiecas uz darījuma un pozīcijas<sup>3</sup> līmeņa ziņojumiem, bet 3. un 4. tabula īpaši attiecas uz ziņojumiem par drošības rezervēm CDP tīrvērtētos VFD un ziņojumiem par atkalizmantošanu.

		Following Steps							
		New	Error	Termination	Modification	Valuation	Collateral	Correction	Position Component
Previous steps	New		x	x	x	x	x	x	
	Error								
	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	

<sup>2</sup> Tabulas saturu var ietekmēt papildu izmaiņas apstiprināšanas noteikumu definīcijā.

<sup>3</sup> Pozīcijas komponents neattiecas uz pozīcijas līmeņa ziņojumiem.

**3. tabula. Drošības rezerves atjaunināšana**

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

**4. tabula. Dati par atkalizmantošanu, naudas atkalieguldīšanu un finansējuma avotiem**

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

80. Izmantojot 2., 3. un 4. tabulu, ir svarīgi saprast, ka tās raksturo darbības veidus, par kuriem var ziņot jebkurā brīdī, tiklīdz tiek iesniegts jauns darbības veids, un tās nav vienīgās atļautās nākamās darbības. Piemēram, pēc ziņojuma nosūtīšanas ar darbības veidu “Pozīcijas komponents” ir atļauts nosūtīt tikai ziņojumus “Labojums” vai “Kļūda”. Taču pēc ziņojuma “Labojums” nosūtīšanas ir atļauts jebkura cita veida ziņojums. Var rasties jautājums — ja struktūra, kas nosūtījusi ziņojumu ar darbības veidu “Pozīcijas komponents” un pēc tam nosūtījusi “Labojums” ar to pašu UDI — vai šī struktūra var arī turpmāk sūtīt ziņojumus ar citiem darbības veidiem. Atbilde ir noliedzoša. Darbības veids “Labojums” neatceļ/ nenoņem loģiskos ierobežojumus, ko izraisīja iepriekšējā ziņojuma iesniegšana ar darbības veidu “Pozīcijas komponents”. Tādēļ šī struktūra turpmāk var iesniegt tikai ziņojumu “Kļūda” vai citu “Labojumu” tam pašam darbības veidam. Tāpat nav nepieciešams vēlreiz izbeigt VFD ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana” pēc labojuma iesniegšanas attiecībā uz jau iepriekš izbeigtu VFD (jo “Labojums” neietekmē darījuma nenokārtotības statusu).
81. Iemesls, kādēļ “Kļūda” un “Labojums” ir vienīgie pieļaujamie darbības veidi pēc ziņojuma ar darbības veidu “Pozīcijas komponents”, ir tāds, ka pēc tam, kad VFD tiek iekļauts pozīcijā, visi nākamie ziņojumi (tostarp nodrošinājuma informācijas atjauninājumi) jāsniedz pozīcijas līmenī. Tādēļ šie ziņojumi jāiesniedz, izmantojot citu UDI (pozīcijas UDI), un ir jāapstiprina arī ziņojumu pareiza secība attiecīgajai pozīcijai.
82. VFD ziņojumi jānosūta hronoloģiskā secībā, kādā notikumi ir notikuši, saskaņā ar ĪTS noteiktajām prasībām. Tomēr tiek atzīts, ka gadījumos, kad struktūra neziņo laikus vai uzzina par nepareizas informācijas iesniegšanu pagātnē, šai struktūrai jānosūta ziņojumi ar pagātnes notikumu datumiem, tādējādi pārkāpjot hronoloģisko secību.
83. Tomēr darījumu reģistram jāpārskata “Notikuma datums” tikai tiktāl, lai pārliecinātos, ka tas nav nākotnes datums (tas ir skaidri norādīts apstiprināšanas noteikumos), un:
  - a. ja notikumu datumi ir “pagātnes” datumi (t. i., mazāki par ziņojuma datumu, “-1”), šie notikumi neizmaina darījumus pēc to termiņa iestāšanās vai izbeigšanas, t. i., paziņotais notikuma datums ir agrāks par termiņa datumu un izbeigšanas datumu, ja tas ir ierakstīts (arī tas ir norādīts apstiprināšanas noteikumos). Darījumu reģistram arī jāpārbauda, vai grozījumi, kas nosūtīti ar pagātnes notikuma datumu, neizmaina iepriekš paziņoto termiņa datumu. Turklāt darījumu reģistram nav jāpiemēro paziņotās izmaiņas ne kārtējam darījuma stāvokļa ziņojumam (ja darījums vēl nav nokārtots), ne iepriekšējam darījuma stāvokļa ziņojumam, norādot datumu, kas tika paziņots par šo notikumu;
  - b. ja notikuma datums sakrīt ar ziņojuma datumu vai dienu pirms ziņojuma datuma, darījumu reģistram jāveic izmaiņas darījuma stāvokļa ziņojumā, pamatojoties uz iesniegšanas secību.
84. Darījumu reģistram jāiesniedz iestādēm visi pieņemtie darījuma stāvokļa ziņojumi, neatkarīgi no notikuma datuma.
85. Darījumu reģistram jāapstiprina pareiza ziņojumu secība, pamatojoties uz to iesniegšanas secību, neatkarīgi no lauka “Notikuma datums” satura.

86. Tā kā dažus pagātnes notikumus var paziņot attiecībā uz darījumiem, kuru termiņš ir beidzies vai kuri ir izbeigti, pēc ziņojuma “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana” ir atļauts nosūtīt ziņojumu “Grozījums”, “Novērtējuma atjaunināšana” vai “Nodrošinājuma informācijas atjaunināšana” (ja notikuma datums ir iestājies pirms termiņa/ izbeigšanas datuma), un tas ir norādīts 2. tabulā.
87. Jāatzīmē, ka par nodrošinājuma nomaiņu nav paredzēts ziņot pēc izbeigšanas notikuma (ja vien izbeigšana netiek atcelta). Tādēļ par izbeigšanu nav jāziņo pirms faktiskā izbeigšanas datuma (papildu informāciju par izbeigšanas ziņojumiem skatīt 4.9.5. punktā).
88. Ja darījumu reģistrs noraida vairākus iepriekšējos iesniegumus, darījumu partnerim tie jāizlabo un atkārtoti jāiesniedz pēc iespējas ātrāk, saglabājot notikumu hronoloģisko secību. Ja šie iepriekšējie ziņojumi attiecas uz notikumiem, kas notikuši ziņojuma datumā vai iepriekšējā dienā, un tādēļ darījumu reģistrs tos ņems vērā, sniedzot darījuma stāvokļa ziņojumu (saskaņā ar iepriekšējo 83. punktu), darījumu partnerim, iespējams, būs atkārtoti jāiesniedz arī iepriekšējie ziņojumi, lai maksimāli atjauninātu darījuma reģistrācijas ierakstus.
89. Attiecībā uz darbības veidu “Kļūda” ir svarīgi atzīmēt, ka pēc paziņošanas to nevar atcelt vai kā citādi “atsaukt”. Tādēļ, ja viens no abiem darījumu partneriem kļūdas dēļ nosūta ziņojumu ar šāda veida darbību, darījumu partneriem jāveic turpmāk minētās darbības, lai turpmāk ziņotu pareizi:
  - a. otram darījumu partnerim arī jānosūta ziņojums ar darbības veidu “Kļūda”, norādot to pašu UDI. Šo UDI vairs nevarēs atkal izmantot;
  - b. abiem darījumu partneriem jāvienojas par jaunu UDI šim darījumam, jāpaziņo tas ar darbības veidu “Jauns” un ar jauno UDI, par kuru panākta vienošanās, un jāturpina ziņot par visiem turpmākajiem dzīves cikla notikumiem, izmantojot šo UDI.
90. Viens izņēmums, kad, iesniedzot darbības veidu “Kļūda”, var nepieprasīt, lai otrs darījumu partneris atceļ darījumu, ir potenciālais scenārijs, kurā viens no darījumu partneriem kļūdas dēļ divreiz paziņo par darījumu diviem dažādiem darījumu reģistriem un vēlas atcelt tikai vienu, lieko iesniegumu. Šajā gadījumā minētajam darījumu partnerim jānosūta ziņojums ar darbības veidu “Kļūda” vienam darījumu reģistram, bet tas pats darījums paliek atvērts otrā darījumu reģistrā un abi darījumu partneri var turpināt ziņot ar to pašu UDI.
91. Jāatzīmē arī, ka šis ierobežojums nav piemērojams, ziņojot par drošības rezervēm un atkalizmantošanu. Piemēram, darījumu partneris var paziņot par atkalizmantošanu kļūdas dēļ (ja atkalizmantošana nemaz nav notikusi); šādā gadījumā tam jāiesniedz atkalizmantošanas ziņojums ar darbības veidu “Kļūda”. Tas tomēr neliedz šim darījumu partnerim vajadzības gadījumā ziņot par atkalizmantošanu vēlākā posmā.

## 4.9 Savlaicīga paziņošana par VFD noslēgšanu, grozīšanu un izbeigšanu

### 4.9.1 VFD noslēgšana

92. Ja noslēgtais VFD vēlāk tiek izbeigts (tostarp, ja tas tiek izbeigts norēķinu neveikšanas dēļ), darījumu partneriem pēc tam, kad viņi to ir paziņojuši ar darbības veidu “Jauns”, jāpaziņo par to ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana”. Ja sākotnējais VFD tika paziņots ar darbības veidu “Pozīcijas komponents” un pēc tam tika izbeigts, darījumu partneri par sākotnējo VFD nedrīkst sūtīt ziņojumu ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana”, tomēr viņiem jānosūta ziņojums ar darbības veidu “Grozījums” attiecībā uz pozīciju, kurā tika iekļauts sākotnējais VFD, lai izņemtu šo VFD no pozīcijas.
93. Darbības veids “Kļūda” jāizmanto tikai tādu darījumu atcelšanai, kuri nekad nav eksistējuši vai kuri neietilpst VFDR noteiktā ziņošanas pienākuma darbības jomā. Īpašā gadījumā, kad darījumu partneri vienojas noslēgt darījumu ar nosacījumu, ka tas tiks reģistrēts CDP, un CDP noraida šo darījumu, darījumu partneriem jāizbeidz VFD ar darbības veidu “Kļūda”, jo darījuma norunātais nosacījums nav izpildīts, tādēļ darījums nekad nav eksistējis.
94. Turklāt jāatzīmē, ka nav jāziņo par pagaidu neveiktiem norēķiniem, ja tie neizraisa VFD izbeigšanu.
95. Īpašajā maržināla aizdevuma gadījumā par VFD noslēgšanu jāziņo tad, kad tam pirmoreiz rodas īstermiņa tirgus vērtība vai neto naudas debeta atlikums (no klienta viedokļa), un tad ir jāpievieno attiecīgs izpildes laika spiedogs.

### 4.9.2 VFD grozīšana un labošana

96. VFD grozīšana paredz ziņošanu ar šādiem darbības veidiem — “Grozījums” un “Labojums”. Ziņojumu iesniegšanas termiņi ir tādi paši kā darījuma noslēgšanai, un tas nozīmē, ka no brīža, kad grozījums stājas spēkā, tas kļūst paziņojams. Attiecīgā gadījumā, piemēram, saistībā ar izmaiņām SLB aizdevuma daļā, tas jāsaprot kā paredzētais norēķinu datums.
97. Darījumu partneriem jāziņo tikai par notikušiem grozījumiem, t. i., nav jāziņo par grozījumiem, par kuriem ir panākta vienošanās, bet kuri stāsies spēkā tikai nākotnē. Piemēram, ja darījumu partneri vienojas pārvērtēt repo darījumu kādā nākotnes datumā, par šo pārvērtējumu būs jāziņo tikai tad, kad iestāsies saskaņotais datums (pārvērtējuma spēkā stāšanās datums).
98. Līdzīgi kā ziņojot par darījumu noslēgšanu, nenotikušie pagaidu norēķini paši par sevi nav paziņojami, ja vien tie neizraisa darījuma grozīšanu, par ko tad būs attiecīgi jāziņo ar darbības veidu “Grozījums”. Piemēram, ja par VFD daļēju atgriešanu tika ziņots kā par grozījumu un pēc tam tā tika atcelta nenotikuša norēķina dēļ, darījumu partneriem jāziņo par vēl vienu VFD grozījumu, lai atsauktu izmaiņas, kas izrietēja no šīs daļējās atgriešanas.

99. Ja VFD tiek grozīts ar atpakaļejošu datumu (piemēram, ja VFD darījumu partneri divpusēji vienojas pārvērtēt darījumu, kura spēkā stāšanās datums ir pagātnē), darījumu partneriem nav atkārtoti jāiesniedz ziņojumi par visām darbībām, kas veiktas pēc datuma, kad stājās spēkā grozījums ar atpakaļejošu datumu. Jāatzīmē, ka ziņojums par grozījumu ar atpakaļejošu datumu jāiesniedz ar pareizo pagātnes notikuma datumu (atbilstoši grozījuma spēkā stāšanās datumam). Šādā gadījumā darījumu reģistriem nav jāpiemēro grozītie dati darījuma stāvokļa ziņojumam<sup>4</sup>.
100. Labojumu gadījumā tie jāpaziņo, tiklīdz tiek identificēti nepareizi paziņotie dati. Korekcijas ziņojums nav jāsniedz, ja pēc VFD grozīšanas darījumu partneris ir iekļāvis nepareizu informāciju tikai savās iekšējās sistēmās — šādos gadījumos uzņēmumam jānosūta tikai grozījuma ziņojums ar galīgajiem un pareizajiem datiem.

#### 4.9.3 Nodrošinājuma informācijas atjauninājumi

101. Par nodrošinājuma informācijas atjauninājumiem jāziņo saistībā ar spēkā stāšanās datumu, t. i., ar plānoto norēķina dienu. Tomēr dažkārt darījumu partneri var vieneties par atjauninājumiem, bet tādu iemeslu dēļ, kas ir attiecināmi uz darījumu partneriem vai trešām personām, piemēram, CDP vai CVD, ir iespējams, ka tie netiks pabeigti. Tas nozīmē, ka attiecīgais nodrošinājuma informācijas atjauninājuma ziņojums jāiesniedz atkārtoti ar pareiziem un galīgiem datiem. Par pagaidu neveiktiem norēķiniem, kas neietekmē nodrošinājumu, par kuru panākta vienošanās, nav jāziņo.
102. Dažos citos gadījumos struktūras jau ir vienojušās par noteiktām izmaiņām nodrošinājumā, bet vēl nav tās īstenojušas. Darījumu partneriem jāziņo tikai par notikušiem nodrošinājuma informācijas atjauninājumiem, un tas nozīmē, ka nav jāziņo par nodrošinājumu ar plānoto norēķina datumu nākotnē.
103. Nodrošinājuma informācijas atjauninājumi ir dienas momentuzņēmuma ziņojumi, kuriem jāraksturo nodrošinājuma stāvoklis konkrētās dienas beigās. Par nodrošinājuma informācijas izmaiņām dienas gaitā nav jāziņo. Īpašā gadījumā, kad dienas darījumiem nodrošinājums tiek sniegts tikai dienas laikā, bet dienas beigās tas ir nulle, darījumu partneriem jāziņo par nodrošinājumu ar nulles vērtību.
104. Attiecībā uz CDP tīrvērtētiem darījumiem uz vietas, kuri iekļauti pozīcijā un par kuriem tiek ziņots ar darbības veidu “Pozīcijas komponents”, nodrošinājuma informācijas atjauninājumi jānosūta attiecībā uz pozīciju, kurā šie darījumi iekļauti, nevis attiecībā uz sākotnējiem darījumiem.
105. Visbeidzot, jāatzīmē, ka pēdējais nodrošinājuma informācijas atjauninājums jāiesniedz par pēdējo dienu, kurā vēl nav nokārtots(-i) atbilstošais(-ie) VFD, un tas jāiesniedz līdz nākamās dienas beigām. Pēc tam, kad par VFD ir iesniegts ziņojums ar darbības veidu “Pirmstermiņa izbeigšana”, vai pēc tam, kad ir iestājies termiņš terminētiem VFD, par šiem VFD nav jāiesniedz nodrošinājuma informācijas atjauninājumi (izņemot trūkstošie novēlotie ziņojumi).

---

<sup>4</sup> Skatīt 4.8.3. punktā papildu informāciju par notikuma datuma ietekmi uz ziņojumu izskatīšanu darījumu reģistros.



106. Īpašā gadījumā ar maržinālu aizdevumu nodrošinājuma informācijas atjauninājumi jānosūta tikai tad, kad tam rodas īstermiņa tirgus vērtība vai neto debeta atlikums (no klienta viedokļa). Ja klients maržinālo aizdevumu vēl nav izmantojis, darījumu partneriem nav jāziņo ne par VFD darījumu, ne par atbilstošo nodrošinājumu. Var būt arī scenāriji, kad klients ir izmantojis maržinālo aizdevumu (tātad par maržinālā aizdevuma darījumu un atbilstošo nodrošinājumu ir paziņots), un pēc tam maržinālais aizdevums sasniedz nulles vērtību. Šādos gadījumos, ja darījumu partneri neizlemj slēgt VFD, tiem jāiesniedz “nulles” nodrošinājuma ziņojums par pirmo dienu, kurā maržinālā aizdevuma vērtība ir nulle. Kad klients atkārtoti izmanto maržinālo aizdevumu, par šo VFD jāpaziņo faktiskās nodrošinājuma vērtības.

#### 4.9.4 Novērtējuma, drošības rezerves un atkalizmantošanas atjauninājumi

107. Novērtējuma atjauninājumu gadījumā darījumu partneriem jāšūta novērtējumi līdz darba dienas beigām katru dienu pēc novērtēšanas datuma un jāieraksta šis datums laukā “Notikuma datums”.
108. Par drošības rezerves atjauninājumiem jāziņo, kad tie stājas spēkā, t. i., plānotajā norēķinu dienā, neņemot vērā pagaidu nenotikušos norēķinus.
109. Īpašajā gadījumā, kad CDP jau iepriekš apmaksā drošības rezerves pirms tīrvērtēto darījumu portfeļa, par tām jāziņo attiecīgā portfeļa (ko sasaista portfeļa kods) pirmā piemērojamā VFD T+1 dienā, nevis nākamajā dienā pēc iesniegšanas dienas.
110. Ziņojot par atkalizmantošanu, ziņošana ir atkarīga no norēķiniem, un tas nozīmē, ka darījumu partneriem jāziņo tikai par tā atkalizmantotā nodrošinājuma vērtību, kas apmaksāts noteiktās dienas beigās. Šis norēķinu datums jānorāda kā notikuma datums atkalizmantošanas ziņojumos, kuri jāiesniedz līdz nākamās dienas beigām (t. i., līdz norēķinu datums+1 dienas beigām). Atkalizmantošanas ziņojumi ir dienas beigu momentuzņēmuma ziņojumi, un tas nozīmē, ka dienas beigās tiem jānorāda atkalizmantotais nodrošinājums, nevis izmaiņas, salīdzinājumā ar iepriekš paziņotajām vērtībām (“delta ziņojums”).

#### 4.9.5 VFD izbeigšana

111. Darījumu partneri nedrīkst sūtīt ziņojumu ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana”, kad VFD ar noteiktu termiņu iestājas šis termiņš un tādēļ tas vairs nav nenokārtots.
112. Ja darījumu partneri vienojas izbeigt noteikta termiņa VFD pirms termiņa vai izbeigt nenoteikta termiņa VFD, tiem vai nu:
- jāiesniedz ziņojums ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana”, ja paredzamais norēķins par izbeigšanu notiek tajā pašā dienā, kad tiek paziņots par izbeigšanu; vai
  - jāiesniedz ziņojums ar darbības veidu “Grozījums”, ja paredzamais norēķins par izbeigšanu notiek nākamajā dienā vai vēlāk. Šādā gadījumā darījumu partneriem attiecīgi jāizmaina termiņš.

113. Tā kā saskaņā ar ziņošanas loģiku, kas paredzēta VFDR RTS/ITS (un atbilstoši pašreizējai ziņošanas loģikai saskaņā ar ETIR), darījumu pēc tā izbeigšanas nav iespējams “atsākt”, darījumu partneriem nav jāziņo par izbeigšanu, ja tā nenotiek nenotikušu norēķinu dēļ.
114. Praksē, ja nākamajā dienā pēc saskaņotās pirmstermiņa izbeigšanas dienas darījumu partneriem kļūst zināms, ka par izbeigšanu nav veikts norēķins plānotajā norēķina dienā, tādā gadījumā līdz norēķinam par izbeigšanu viņi nedrīkst sūtīt ziņojumu ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana”. Ja izbeigšana tiek atcelta nenotikuša norēķina dēļ, darījumu partneri nedrīkst sūtīt ziņojumu ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana”, jo VFD joprojām nav nokārtots.
115. Līdzīgi, arī attiecībā uz VFD, kas tuvojas termiņa beigām (vai nu sākotnēji līgumā noteiktajam termiņam (2.14. lauks), vai grozītajam termiņam, lai ziņotu par pirmstermiņa izbeigšanu, par kuru iepriekš ir panākta vienošanās), ja nākamajā dienā pēc termiņa beigām darījumu partneriem kļūst zināms, ka par VFD pēdējo daļu nav noticis norēķins, viņiem jānosūta grozījuma ziņojums, lai nomainītu termiņa datumu uz nākamo dienu vai citu dienu nākotnē, kurā tiek plānots veikt norēķinu. Jāatzīmē, ka šādi termiņa grozījumi ir iespējami tikai līdz nākamajai dienai pēc termiņa beigām, jo no šī datuma VFD vairs nebūs nenokārtots un to nebūs iespējams “atkārtoti atvērt”. Ja atgriešanas norēķins ir sekmīgs, darījumu partneri nedrīkst sūtīt papildu ziņojumus, jo VFD no nākamās dienas pēc termiņa beigām tiks uzskatīts par ne-nenokārtotu.

#### 4.9.6 Pārskats par ziņošanas termiņiem atkarībā no ziņojuma veida un darbības veida

116. 5. tabula norāda, kas jāpaziņo kā “Notikuma datums” katram ziņojuma veidam un darbības veidam. Notikuma datums pēc definīcijas norāda arī to, kas ir izraisījis ziņošanu, piemēram, plānotais norēķina datums nodrošinājuma informācijas atjaunināšanas gadījumā vai novērtējuma datums novērtējuma atjaunināšanas gadījumā. Aktualizēti ziņojumi ir jāiesniedz līdz darbdienas beigām nākamajā dienā pēc notikuma datuma.

5. tabula. Notikuma datums		
Table	Action type	Notikuma datums
1&2	NEWT	Līguma noslēgšanas datums (“darījuma datums”)
1&2	MODI	Grozījuma spēkā stāšanās datums vai attiecīgā gadījumā — plānotais norēķina datums
1&2	CORR	Datums, no kura jāpiemēro labojums (parasti tas ir datums, par kuru iepriekš tika paziņoti nepareizi dati)
1&2	ETRM	Plānotais norēķina datums attiecībā uz izbeigšanu
1&2	EROR	Nepiemēro
1&2	COLU	Plānotais norēķina datums
1&2	VALU	Novērtējuma datums
3	NEWT	Plānotais norēķina datums
3	MARU	Plānotais norēķina datums
3	CORR	Datums, no kura jāpiemēro labojums (parasti tas ir datums, par kuru iepriekš tika paziņoti nepareizi dati)
3	EROR	Nepiemēro
4	NEWT	Faktiskais norēķina datums

4	REUU	Faktiskais norēķina datums
4	CORR	Datums, no kura jāpiemēro labojums (parasti tas ir datums, par kuru iepriekš tika paziņoti nepareizi dati)
4	EROR	Nepiemēro

#### 4.10 Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem

117. 6. tabula parāda kartēto saikni starp uzņēmējdarbības notikumiem, kas notikuši VFD dzīvescikla laikā, un darbības veidiem, kas definēti TS par ziņošanu.
118. Ja darījumu partneri vienojas pirms termiņa izbeigt un nomainīt VFD, par to ir attiecīgi jāpaziņo. Šādos gadījumos darījumu partneriem vispirms jāizbeidz sākotnējais VFD (nosūtot "Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana" vai "Grozījums" ar izmainītu termiņa datumu) un pēc tam jāiesniedz ziņojums par jauno darījumu (ar darbības veidu "Jauns").
119. Tāpat, lai vienkāršotu tabulu, visi notikumi, kuru rezultātā tiek izbeigts VFD, tiek sasaistīti ar darbības veidu "Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana", izņemot 44. gadījumu, kas īpaši attiecas uz ziņošanu par izbeigšanu. Tomēr tiek atzīts, ka gadījumos, kad tiek panākta vienošanās par darījuma izbeigšanu citā datumā nākotnē, par to parasti jāziņo kā par termiņa datuma grozījumu (ar darbības veidu "Grozījums"), turpretim par izbeigšanu tajā pašā dienā jāziņo ar darbības veidu "Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana".
120. TS par ziņošanu nevar iekļaut nekādus papildu darbības veidus, tādēļ darījumu partneriem jāizmanto TS iekļautie darbības veidi, ziņojot par VFD un attiecīgajiem uzņēmējdarbības notikumiem, kas ar VFD saistīti.
121. Uzņēmējdarbības dzīvescikla notikumi dažādiem VFD veidiem jāpaziņo, izmantojot šādus darbības veidus (2.98. lauks) un attiecīgos līmeņus (2.99. lauks)<sup>5</sup>.

6. tabula. Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem						
New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Piezīmes un piemēri
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	Tas ietver apvienotus lielapjoma darījumus, kas pārstāvim jāsadala klientiem. Tas ietver arī visus paziņojamos darījumus, kas noslēgti norēķina nolūkā (automātisks nodrošinājums, ko sniedz (I)CVD, citas kredītlīnijas, vērtspapīru automātiska aizņemšanās dienas laikā no (I)CVD). Par norēķinu sākuma posmā, tostarp par novēlotu norēķinu, kas neizraisa

<sup>5</sup> Uzņēmējdarbības notikumu saraksts nav noslēgts.

<sup>6</sup> Atsauces attiecas uz tabulām, kas iekļautas RTS un ITS par ziņošanu.

**6. tabula. Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Piezīmes un piemēri
						VFD izbeigšanu vai citas izmaiņas tajā, <b>nav</b> jāziņo atsevišķi. Maržināla aizdevuma gadījumā par noslēgšanu jāpaziņo tad, kad kredīts tiek pagarināts pirmo reizi.
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	Tas ietver, piemēram, pagarināma repo darījuma pagarināšanu, ad hoc vienošanos par noteikta termiņa repo darījuma atpirkšanas datuma maiņu vai vienošanos par atpirkšanas datuma atlikšanu neveiksmju pārvaldības procesa ietvaros.
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	ERROR	-	
7	New allocation of the SFTs	All	Table 1 and Table 2	NEW T	TCTN	Piemēram, kad pārstāvis izpauž pamatsummas otrai pusei "apvienotā" aģentūras tipa repo darījumā.
8	Full reallocation with a new UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEW T	TCTN	Tas ietver arī scenāriju, kurā pārdale notiek pirms norēķina par sākotnējā darījuma sākumposmu.
9	Full reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	ETRM + MOD I	TCTN	Tas ietver arī scenāriju, kurā pārdale notiek pirms norēķina par sākotnējā darījuma sākumposmu.
10	Partial reallocation to a new UTI	All	Table 1 and Table 2	MOD I + NEW T	TCTN	Tas ietver arī scenāriju, kurā pārdale notiek pirms norēķina par sākotnējā darījuma sākumposmu.
11	Partial reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	MOD I + MOD I	TCTN	Tas ietver arī scenāriju, kurā pārdale notiek pirms norēķina par sākotnējā darījuma sākumposmu.
12	Increase or reduce size of a repo by modifying the terms of the contract (same	REPO	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	

**6. tabula. Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Piezīmes un piemēri
	UTI, no settlement instructions issued)					
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	Par norēķinu attiecībā uz daļēju atgriešanu, tostarp par novēlotu norēķinu, kas neizraisa daļējās atgriešanas atcelšanu, nav jāziņo atsevišķi.
16	Cancellation or failure of the partial return	SBL	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	Par novēlotu norēķinu, kas neizraisa daļējās atgriešanas atcelšanu, nav jāziņo.
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	Ja par pārvērtēšanu nav panākta vienošanās, bet kļūdas dēļ par to ir paziņots vienpusēji, par izmaiņu, atgriežoties pie iepriekšējā vērtējuma, jāziņo ar "CORR".
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	Šā notikuma rezultāts būs ziņojums par grozījumu atpirkšanas cenā.
21	Events impacting the collateral value	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	COL U	-	Piemēram, nodrošinājuma ienākuma izmaksa (repo darījums, BSB), saražotais maksājums (repo darījums, BSB), plānotās izmaiņas mainīgas likmes nodrošinājuma vērtējumā vai indekss, kas raksturo indeksam piesaistītu nodrošinājumu jebkura veida repo darījumā.
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	-	

**6. tabula. Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Piezīmes un piemēri
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	-	Katram maržinālam aizdevumam ir tikai viena pamatvalūta, tādēļ papildu pamatvalūta jāpaziņo kā jauns maržināls aizdevums ar jaunu UDI.
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	Darbības veidu NEWT izmanto, ja informācija par nodrošinājumu tiek paziņota kopā ar cita VFD informāciju ziņojumā par jaunu darījumu. Tas varētu būt, piemēram, scenārijs, kurā pārdevējs piešķir nodrošinājumu jaunam GC repo darījumam vai trīspusējs pārstāvis pirmo reizi piešķir nodrošinājumu darījuma dienā.
31	First allocation of collateral after the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN	Tas varētu būt, piemēram, scenārijs, kurā pārdevējs piešķir nodrošinājumu jaunam GC repo darījumam vai trīspusējs pārstāvis pirmo reizi piešķir nodrošinājumu pēc darījuma dienas.
32	Substitution of Collateral	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	Tas ietver, piemēram, vērtspapīru pagaidu aizstāšanu ar skaidru naudu (parasti to dara trīspusējs pārstāvis), ja pārdevēja kontā trūkst piemērota nodrošinājuma, pagaidu skaidras naudas nodrošinājuma aizstāšanu ar vērtspapīru nodrošinājumu, pagaidu skaidras naudas nodrošināšanu pret nokavētu vērtspapīru atgriešanu reaģējot uz izmaiņām pieprasījumā pēc mainīgās drošības rezerves saskaņā ar līgumu GMRA 6(h). Tas ietver arī visas izmaiņas nodrošinājumā, ko rada korporatīvie notikumi.
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 convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	

**6. tabula. Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Piezīmes un piemēri
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 jāpaziņo tikai tad, kad VFD tiek izbeigts pēc nodrošinājuma emitenta saistību neizpildes. Pretējā gadījumā par nodrošinājuma aizstāšanu jāziņo ar COLU.
38	Variation margining	REPO, SLB, BSB	Table 1 and Table 2	COLU	-	Tas ir atsevišķs COLU ziņojums par neto riska darījumu.
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	Tas ietver tiešos (OTC) darījumus, kas tīrvērtēti tajā pašā dienā vai pēc tās.
41	Post-trade clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEWT	TCTN / PSTN	Tas ietver tirdzniecības vietā slēgtos darījumus, kas tīrvērtēti pēc tirdzniecības dienas.
42	Same-day clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	NEWT	TCTN / PSTN	Tas ietver tirdzniecības vietā slēgtos darījumus, kas tīrvērtēti, izmantojot atvērtā piedāvājuma modeli un tās pašas dienas novācību.
43	CCP rejects transaction which is conditional upon registration with the CCP	All	Table 1 and Table 2	ERROR	-	
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	Par izbeigšanu tajā pašā dienā jāziņo ar ETRM, turpretim MODI jāizmanto, lai ziņotu par izbeigšanu nākotnē (izmainot termiņa beigu datumu).
45	Termination of an evergreen or puttable SFT	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MODI	TCTN	Tas ietver izbeigšanas izvēles izslēgšanu.
46	Maturity/Expiration	All	Table 1 and Table 2	no report	-	Par pagaidu neveiktajiem norēķiniem VFD, kura termiņš beidzas, nav jāziņo atsevišķi.
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	-	Par norēķinu attiecībā uz pilnu atgriešanu, tostarp par novēlotu norēķinu, kas neizraisa pilnās atgriešanas atcelšanu, nav jāziņo atsevišķi.



**6. tabula. Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Piezīmes un piemēri
48	Cancellation or failure of the full return	SBL	Table 1 and Table 2	no report or NEW T	TCTN	Par pilnu atgriešanu nav jāziņo, ja netiek veikts norēķins, tādēļ, ja pilna atdošana tiek atcelta, papildu ziņojums netiek prasīts. Tomēr, ja par pilnu atgriešanu ir ziņots ar ETRM un pēc tam pilnā atgriešana tiek atcelta, par darījumu jāziņo atkārtoti ar darbības veidu NEWT un jaunu UDI.
49	Closure of an SFT due to counterparty default	All	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Tas ietver, piemēram, darījumu partnera piesaisti noklusējumam ar nosacījumu, ka par šo noklusējuma iespēju ir panākta vienošanās saskaņā ar GMRA 10. punkta a) apakšpunkta ii) daļu.
50	Termination of transaction under specific GMRA provisions	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Tas ietver: darījuma izbeigšanu saskaņā ar GMRA 2000 10. noteikuma g) punktu vai GMRA 2011 10. noteikuma h) punktu; "mini slēgšanu" saskaņā ar GMRA 2000 10. noteikuma h) punktu vai GMRA 2011 10. noteikuma i) punktu; pārcenošanu vai korekciju saskaņā ar GMRA 2000 4. noteikuma i)–k) punktu vai GMRA 2011 4. noteikuma j)–l) punktu.
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	Darījumu partneri vienojas grozīt darījuma atribūtu. Šis ir apkopojošs notikums attiecībā uz visiem grozījumiem, kas nav minēti atsevišķi.
53	Amend trade - unilateral	All	Table 1 and Table 2	COR R	TCTN / PSTN	Viens darījumu partneris izlabo darījuma atribūtu.
54	Amend collateral - bilateral	All	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN / PSTN	Darījumu partneri vienojas grozīt nodrošinājuma atribūtu. Šis ir apkopojošs notikums attiecībā uz visiem grozījumiem, kas nav minēti atsevišķi.
55	Amend collateral - unilateral	All	Table 1 and Table 2	COR R	TCTN / PSTN	Viens darījumu partneris izlabo nodrošinājuma atribūtu.
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	Nav iespējams labot nepareizi paziņotu pirmstermiņa izbeigšanu vai kļūdu. Kad ir nosūtīts ziņojums ar šiem darbības veidiem, nav iespējams atjaunot darījuma nenokārtotības statusu, un tādēļ darījums ir jāpaziņo atkārtoti ar darbības veidu NEWT un jaunu UDI.



**6. tabula. Uzņēmējdarbības notikumu kartēšana pēc darbības veidiem un līmeņiem**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Piezīmes un piemēri
57	Transaction not executed or out of scope of SFTR but reported to TR by mistake	All	Table 1 and Table 2	ERROR	-	
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	ERROR	-	
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	-	
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 CVD dalībnieka identifikācija

122. Izņemot gadījumus, kad ziņo par maržinālu aizdevumu vai ja darījums ir saistīts ar precēm, darījumu partneriem vienmēr jāaizpilda Centrālā vērtspapīru depozitārija (CVD) dalībnieka vai netiešā dalībnieka lauks. Šis lauks jāpaziņo arī tad, kad VFD norēķini notiek ārpus CVD. ESMA vēlas, lai ziņojošais darījumu partneris paziņotu minēto lauku, izmantojot šādu loģiku:
- paziņotu savu LEI, ja norēķinu veic tieši, ar jebkuru CVD, t. i., šis darījumu partneris ir CVD dalībnieks;
  - paziņotu savu LEI, ja norēķinās par vērtspapīriem kādā no diviem ICSD, pat ja šis ICSD nav CVD emitents, t. i., ja darījumu partneris ir ICSD dalībnieks;
  - paziņotu savas turētājbankas LEI, neatkarīgi no tā, vai turētājbanka izmanto kādu apakšdepozitāriju. Tas ietver gadījumus, kad darījumu partneris izmanto koordinējošo aizdevēju.
123. Darījumu partnerim laukā “CVD dalībnieks” nav jānorāda tā CVD LEI, kurā šis partneris ir tiešs vai netiešs dalībnieks.

## 4.12 Darījumu partnera puses noteikšana

### 4.12.1 Vispārīgs gadījums

124. Repo darījumu vai BSB gadījumā nodrošinājuma ņēmējs ir pircējs, savukārt nodrošinājuma sniedzējs ir pārdevējs.
125. SLB darījumu vai ar precēm saistītu VFD gadījumā nodrošinājuma ņēmējs ir aizdevējs, savukārt nodrošinājuma sniedzējs ir aizņēmējs.
126. Maržinālo aizdevumu gadījumā nodrošinājuma ņēmējs ir aizdevējs, savukārt nodrošinājuma sniedzējs ir aizņēmējs.

### 4.12.2 CDP tīrvērtētie VFD

127. CDP tīrvērtētu VFD gadījumā CDP veic starpniecību starp diviem VFD darījumu partneriem. Tādējādi CDP būs pircējs pārdevējam, aizņēmējs aizdevējam, pārdevējs pircējam un aizdevējs aizņēmējam.

### 4.12.3 Ziņošana par nenodrošinātu vērtspapīru aizdevumu/ aizņēmumu

128. Nenodrošinātu vērtspapīru aizdevumu un aizņēmumu gadījumā darījumu partnerim, kurš vērtspapīrus aizdod, jāziņo par sevi kā nodrošinājuma ņēmēju, un darījumu partnerim, kurš vērtspapīrus aizņemas, 1.9. laukā jānorāda sevi kā nodrošinājuma sniedzēju.

#### 4.12.4 Darījumu partnera puses paziņošana neto riska darījuma nodrošināšanas gadījumā

129. Neto riska darījuma nodrošināšanas gadījumā darījumu partneriem laukā “Darījumu partnera puse” nav jāziņo par nodrošinājumu, ko izmanto kā mainīgo drošības rezervi. Tomēr darījumu partneriem pēc tam, kad ir noteikts, kurš ir neto nodrošinājuma sniedzējs un kurš ir neto nodrošinājuma ņēmējs, jāziņo par nodrošinājumu, kas attiecas uz mainīgo drošības rezervi, kā aprakstīts 5.4.7. punktā.

### 4.13 Cenas un vērtības lauki

#### 4.13.1 Novērtēšanas termiņi

130. Kad VFD ir tīrvērtēts, VFDR ziņojumos jāizmanto no CDP iegūtā informācija, kas attiecas uz novērtējumiem.
131. Vērtspapīru tirgus vērtībai jābūt tai, kāda tā ir katras darbadienas beigās, un tā jāpaziņo ne vēlāk kā T+1 dienā, atbilstoši nodrošinājuma pārvaldības nolūkā izmantotajam novērtējumam, piemēram, lai aprēķinātu dienas mainīgo drošības rezervi.
132. Darījumu partneriem jāpaziņo savu VFD tirgus vērtību, pamatojoties uz tirgus cenām un valūtas kursiem, ko šie darījumu partneri ir izmantojuši attiecīgās darbadienas laikā riska darījumu pārvaldības vajadzībām. Vērtspapīru aizdošanas darījumos tas parasti nozīmē, ka tirgus vērtības, kas paziņotas jebkuras konkrētās dienas darba beigās, ir vērtspapīru slēgšanas cenas iepriekšējā darbadienā, kas paziņotas ne vēlāk kā T+1 dienā.
133. Ja iesniedz novērtējumus par divām dažādām dienām, darījumu partneriem attiecīgi jāaizpilda 2.3. lauks “Notikuma datums” par katru atsevišķo dienu.

#### 4.13.2 Aprēķina metode novērtējumos

134. Ziņojot saskaņā ar VFDR, darījumu partneriem jāizmanto vērtība, ko viņi izmanto nodrošinājuma pārvaldībai un riska darījumu pārvaldībai.
135. Ja tirgus vērtība nav pieejama, VFDR neparedz konkrētu metodi šo novērtējumu aprēķināšanai. Tomēr dati, kas norādīti 2.57. un 2.88. laukā, ir salīdzināmi dati, tādēļ darījumu partneriem jāvienojas un jāpaziņo vērtības, kas nepārkāpj pielaišanas robežas, kā aprakstīts pielikumā RTS par datu vākšanu.
136. Vērtspapīru tirgus vērtība jāpaziņo katras darbadienas darba beigās, atbilstoši nodrošinājuma pārvaldības nolūkā izmantotajam novērtējumam, piemēram, lai aprēķinātu dienas mainīgo drošības rezervi.
137. Ja vērtējamajiem vērtspapīriem nav pieejama tirgus cena, ziņojošajam darījumu partnerim jāizmanto jaunākā pieejamā tirgus cena kā atkāpšanās iespēja.
138. Darījumu partneriem attiecīgi jāizmanto valūtas XML birkas visos cenu laukos, lai pareizi identificētu attiecīgos vērtības un summas laukus, jo īpaši gadījumos, kad tie ir izteikti citā valūtā. Skatīt arī piemēru 5.2.1.8. punktā.

139. Ja darījumu partnerim jāizmanto valūtas kurss, lai iesniegtu precīzu novērtējumu, jāizmanto attiecīgais ECB kurss. Ja konvertēšanai nav pieejams ECB valūtas kurss, darījumu partneriem savstarpēji jāvienojas, kuru valūtas kursu izmantot novērtēšanas un ziņošanas nolūkiem.

#### **4.14 CFI koda paziņošana vērtspapīram, kuru izmanto kā nodrošinājumu**

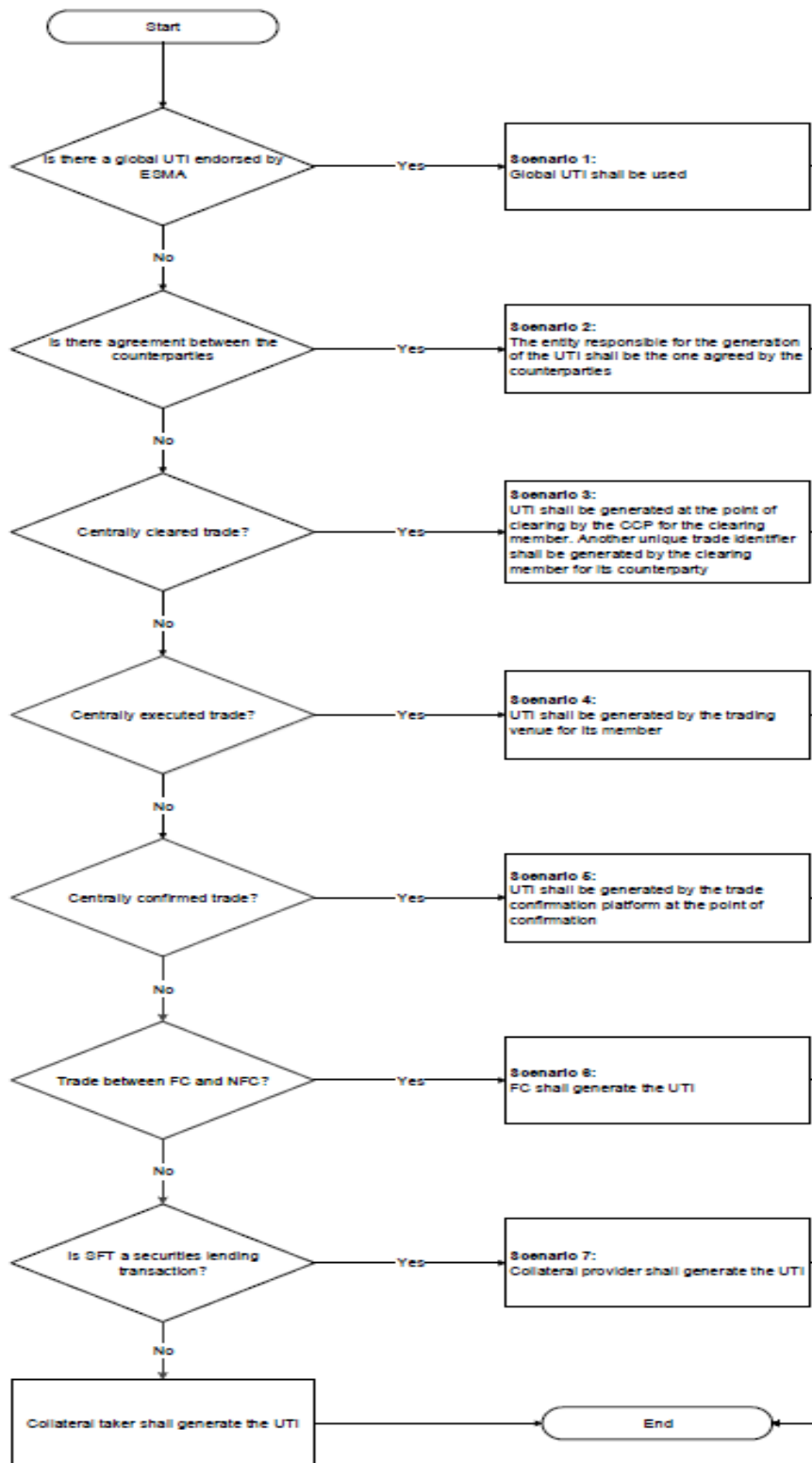
140. Ja vērtspapīru izmanto kā nodrošinājumu, šā vērtspapīra CFI kods jāieraksta tabulas "Aizdevuma un nodrošinājuma dati" 42. un 79. laukā. Šis lauks neattiecas uz precēm.
141. Darījumu partneriem vienmēr jāizmanto oficiāli avoti CFI noteikšanai. Šim nolūkam jāizmanto dati, ko publicējusi attiecīgā Valsts numerācijas aģentūra (NNA). Papildu informāciju NNA asociācija (ANNA) sniedz šajā saitē: <http://www.anna-web.org/standards/about-identification-standards/>, vai attiecīgā vērtspapīra NNA.
142. Darījumu partneriem jāpaziņo tikai derīgi CFI kodi. Ja oficiālajos avotos CFI nav pieejams, darījumu partneriem par to ir jāvienojas, jo CFI ir salīdzināms lauks.

#### **4.15 Atlikšana**

143. Darījumu partneriem, kuri nolemj ziņot par iepriekšējo RSD, jāpaziņo pilnīga un precīza informācija par attiecīgajiem atliktajiem darījumiem, tostarp nodrošinājuma dienas atjauninājums, norādot darbības veidu "COLU". Ja viņi ziņo par daļu no saviem VFD, viņiem jāpaziņo pilnīga un precīza informācija par drošības rezerves un atkalizmantošanas datiem, kas minēti TS par ziņošanu pielikuma 3. un 4. tabulā.
144. Ja attiecīgais RSD attiecas uz abiem darījumu partneriem, viņiem jāvienojas par to, uz kuru dienu viņi atliek VFD, lai saīsinātu saskaņošanas pārtraukumus. Jebkurā gadījumā atliktie darījumi jāpaziņo līdz RSD+190 dienai. Ja ziņojošais darījumu partneris, kuram RSD vēl nav iestājies, nolemj ziņot par atliktajiem darījumiem, viņam jāpārliecinās, ka katrs paziņotais VFD atbilst 146. punktam.
145. Ja darījumu partneri tā nolemj, ir iespējama arī brīvprātīga un pilnīga ziņošana par atliktajiem VFD, t. i., ziņošana par visiem VFD, kas ir atvērti noteiktā laika posmā pēc pirmā RSD un pirms minētā termiņa beigām.
146. Par atliktu darījumu jāziņo ar darbības veidu (2.98. laukā), ierakstot "NEWT". Laukā "Izpildes laika spiedogs" (2.12. lauks) jāieraksta sākotnējais izpildes laika spiedogs. Laukā "Valutēšanas diena (sākuma datums)" (2.13. lauks) jāieraksta sākotnējā valutēšanas diena, ja vien tā nav mainīta VFD norēķinu problēmu dēļ. Pārējos datu laukos jāraksturo stāvoklis ziņošanas laikā. Par iepriekšējiem dzīvescikla notikumiem nav jāziņo atsevišķi.

#### **4.16 UDI izveide un struktūra**

147. UDI izveides procesu ilustrē šāda diagramma.



148. Tīrvērtētu VFD gadījumā par katru VFD starp CDP un tīrvērtes dalībniekiem, kā arī starp tīrvērtes dalībniekiem un viņu klientiem, jāziņo ar dažādiem UDI.

149. Jāatzīmē, ka vienošanās par UDI starp darījumu partneriem praksē ir atkāpšanās iespēja saskaņā ar tehniskajos standartos noteikto ietvaru, jo lielākā daļa struktūru UDI izveidē paļaujas uz “Waterfall” metodiku. Tomēr pusēm var būt šāda vienošanās, un tādā gadījumā tām vajadzētu to ievērot visos gadījumos, uz kuriem attiecas šī vienošanās.
150. Nenoteikta termiņa VFD gadījumā darījumu partneriem jā saglabā šim VFD sākotnēji izveidotais UDI, un tie nedrīkst atkārtoti veidot jaunu UDI katram atjauninājumam.
151. Darījumu partnerim, kas neveic UDI izveidi, jāspēj savās sistēmās vai par ziņošanu atbildīgās struktūras sistēmās, vai ziņojuma iesniedzēja struktūras sistēmās ieviest UDI, ko paziņojis tas darījumu partneris, kurš UDI izveidojis.
152. Darījumu partneriem jāizveido attiecīgi tehniskie mehānismi, kas ir piemēroti apmaināmo datu apjomam, lai nodrošinātu savlaicīgu saziņu un UDI ieviešanu. Ja rodas problēmas ar UDI izveidi vai paziņošanu, darījumu partneriem jānodrošina savlaicīgs jebkuras problēmas, kas saistīta ar UDI izveidi un paziņošanu, risinājums un jāiesniedz ziņojums līdz VFD paziņošanas termiņam.
153. Ja pats UDI nav pareizs, darījums jāatceļ un jāpaziņo kā jauns darījums ar pareizu UDI.
154. Attiecībā uz UDI formātu VFD darījumu partneri var apsvērt CPMI-IOSCO norādījumu izmantošanu, un tie iesaka jaunus UDI strukturēt kā saliktas kombinācijas, kas sastāv no:
  - a. UDI veidojošās struktūras LEI, kas bija derīgs izveides brīdī, un
  - b. minētās struktūras radīta unikāla lieluma (šim lielumam jābūt unikālam tikai to lielumu kopumā, ko minētā struktūra izveido, jo kombinācija ar LEI nodrošinās vispārējo unikalitāti).

#### **4.17 Saņēmēju identificēšana un paziņošana**

155. Parasti — taču var būt arī citi gadījumi — var izdalīt jumta un apakšfondu struktūras, kur jumta fonds ir darījumu partneris, bet apakšfonds vai apakšfondi ir saņēmēji.
156. Var būt arī gadījumi, kad saņēmējs ir kopfonds ar ierobežotu dalībnieku loku; šādos gadījumos LEI jāizmanto, lai identificētu minēto kopfondu<sup>7</sup>.

#### **4.18 Vērtspapīru emitenta un vērtspapīru identifikācija**

157. Darījumu partneriem jāpaziņo aizdoto vai aizņemto vērtspapīru emitentu LEI, nodrošinājumam izmantoto vērtspapīru emitentu LEI, kā arī vērtspapīru ISIN numurs.
158. Paziņojot šo informāciju, darījumu partneriem jānodrošina, ka starp saskaņā ar apstiprināšanas noteikumiem paziņoto ISIN un emitenta LEI ir atbilstība.

---

<sup>7</sup> Kā minēts Finanšu stabilitātes padomes (FSP) 2012. gada ziņojuma “Globālais juridisko personu identifikators finanšu tirgiem” 8. ieteikumā, aktīvu kopfondiem vai citām nodalītām juridiskas personas daļām var būt atsevišķas tiesības un pienākumi pietiekamā neatkarības no šīs juridiskās personas līmenī, un tās ir tiesīgas uz LEI. Tās atbilst arī ISO standartam 17442:2012 par juridisko identifikatoru.

## 4.19 Procedūra, kad darījumu partnerim tiek veikta korporatīva darbība

159. Struktūrai ar jaunu LEI (piemēram, struktūrai, kas apvienota vai iegādājas citu struktūru — turpmāk “jauna struktūra”) jāpaziņo darījumu reģistram, kuram tā ziņoja par saviem VFD, par izmaiņām un jāpieprasa atjaunināt nenokārtoto VFD identifikatoru, kā turpmāk noteikts 162. punktā. Ja identifikatora maiņa notiek apvienošanas vai iegādes rezultātā, arī struktūrai, kas apvienota vai iegādājas citu struktūru, attiecīgi jāatjaunina iegādātās/ apvienotās struktūras LEI ieraksts. Attiecīgā gadījumā darījumu partnerim jāiesniedz arī informācija par valsts nomaiņu.
160. Ja notiek korporatīvi pārstrukturēšanas notikumi, kas ietekmē visus nenokārtotos VFD, darījumu reģistram jāidentificē visi nenokārtotie VFD, ja struktūra ir identificēta ar veco LEI tādos laukos kā ziņojošā darījumu partnera ID un otra darījumu partnera ID, un jānomaina vecais LEI ar jauno.
161. Citi korporatīvas pārstrukturēšanas notikumi, piemēram, daļējas iegādes vai atdalīšanās, bet ne tikai tie, var ietekmēt tikai daļu no nenokārtotajiem VFD, un tādā gadījumā jaunajai struktūrai attiecīgi jāiesniedz darījumu reģistram to VFD, ko ietekmē šis notikums, UDI.
162. Tas jā dara šādā kontrolētā procesā.
- Jaunā struktūra iesniedz rakstveida dokumentāciju darījumu reģistram, kuram tā ziņoja par saviem VFD, un pieprasa izmainīt LEI korporatīva notikuma dēļ. Dokumentācijā skaidri jāizklāsta šāda informācija: i) to struktūru LEI, kuras iesaistītas apvienošanā, iegādē vai citā korporatīvā notikumā, ii) jaunās struktūras LEI, iii) datums, kurā izmaiņas notiek, un iv) attiecīgo nenokārtoto VFD UDI.  
  
Apvienošanas vai iegādes gadījumā dokumentācijā jāiekļauj apliecinājoši dokumenti vai pierādījumi, ka korporatīvais notikums ir noticis vai notiks un ir pienācīgi parakstīts. Iespēju robežās struktūrai jāiesniedz prasītā informācija iepriekš, lai izmaiņas netiktu veiktas ar atpakaļejošu datumu, bet no datuma, kas norādīts iii) daļā. Jāatzīmē, ka jaunā LEI savlaicīga neatjaunināšana izraisīs struktūras iesniegto ziņojumu noraidīšanu, ja tā iepriekš būs identificēta ar veco LEI, kuram būs atbilstošs statuss (t. i., “Izdots”, “Gaida pārskaitījumu” vai “Gaida arhivēšanu”), un šis statuss vēlāk tiks nomainīts uz “Apvienots”.
  - Darījumu reģistram jāpārraida šī informācija visiem pārējiem darījumu reģistriem, izmantojot īpašu failu, kurā tiek iekļauts i) vecais LEI, ii) jaunais LEI un iii) datums, kurā jāveic izmaiņas. Iespēju robežās šis fails jāpārraida iepriekš, lai izmaiņas netiktu veiktas ar atpakaļejošu datumu, bet no datuma, kas norādīts iii) daļā.
  - Katrs VFD darījumu partneris, kurā tiek identificēta kāda no apvienotajām struktūrām, darījumu reģistram, kuram tas ziņo, jāinformē par minētajām izmaiņām.
  - Darījumu reģistriem jāinformē arī regulatori, kuriem ir piekļuve atjauninātajiem datiem par VFD.
  - Vajadzības gadījumā darījumu reģistram jāatjaunina 1.12. lauks “Otra darījumu partnera valsts”.
  - Izmaiņas jāglabā ziņojumu žurnālā, kuru uztur katrs darījumu reģistrs.

163. Turpmākie ziņojumi, kā parasti, jāapstiprina GLEIF un jānoraida, ja apstiprināšana netiek veikta.
164. Tādējādi netiek prasīts, lai struktūra iesniegtu ziņojumu jauna LEI gadījumā.
165. Iepriekš minētā procedūra nav jāievēro, ja darījumu partneri sevi identificē nepareizi. Tādā gadījumā viņiem jāiesniedz VFD ziņojums ar darbības veidu "KĻŪDA", jāvienojas par jaunu UDI ar otru darījumu partneri un jāpaziņo pilnīga un precīza VFD informācija.

## 4.20 Ziņošana pakāpeniskas ieviešanas periodā

166. Darījumu partneriem, kuriem ziņošanas pienākums vēl nav sācies, jāiesniedz tam darījumu partnerim, kuram ir sācies ziņošanas pienākums, visa attiecīgā informācija saskaņā ar TS par ziņošanu. Informācija, kas jāiesniedz ziņojošajam darījumu partnerim, sastāv no diviem datu laukiem. Šie datu lauki ir "Otrs darījumu partneris", "Otra darījumu partnera filiāle" un "Otra darījumu partnera valsts". Informācija šiem datu laukiem laikus jāiesniedz ziņojošajam darījumu partnerim.
167. Ja darījumu partneriem, kuriem ziņošanas pienākums vēl nav sācies, tā ir vieglāk, viņi var sākt ziņošanu vēl pirms attiecīgā ziņošanas sākuma datuma, kas norādīts VFDR 33. panta 2. punkta a) apakšpunktā. Ja darījumu partneris, kuram ziņošanas pienākums vēl nav sācies, nolemj ziņot par darījumiem, viņam jāievēro 144. punkts pamatnostādņu 4.15. iedaļā.

## 5 VFDR lauku tabulas

168. RTS par ziņošanu 1. panta 1. punktā ir paredzēts: "Ziņojumā, kas sagatavots saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 2015/2365 4. panta 1. punktu, iekļauj pilnīgu un precīzu informāciju, kas norādīta pielikuma 1., 2., 3. un 4. tabulā un ir saistīta ar attiecīgo VFD." Izmantošanas gadījumi, kas paredzēti 5.1.–5.6. punktā, ne vienmēr ietver visus laukus, kas saistīti ar attiecīgo VFD, bet tie pievēršas konkrētām datu lauku iedaļām, lai sniegtu sistemātiskākas un detalizētākas norādes par ziņošanu, bez liekiem atkārtojumiem vai citu datu elementu iekļaušanas.
169. Apstiprināšanas noteikumos ir iekļautas pilnīgas norādes par piemērojamiem laukiem katram VFD veidam, darbības veidam un līmenim, kā arī attiecīgās sakarības.
170. Nākamajās iedaļās ir iekļauti dažādi scenāriji un atbilstošās tabulas, kurās paskaidrots, kā par šiem scenārijiem jāziņo. Katrā tabulā ir parādīti ziņojuma lauki saskaņā ar VFDR tehniskajiem standartiem. Ailē "Lauks" ir norādīts katra lauka nosaukums, un ailē "Piemērs" ir sniegts piemērs par to, kas būtu jāiekļauj šajā laukā. Pēdējā ailē "XML ziņojums" ir norādīts formāts XML ziņojumam, kas jāiesniedz ziņojumā par darījumu.
171. Ja vien konkrētajā scenārijā nav norādīts citādi, uz visiem 5. iedaļā izklāstītajiem scenārijiem attiecas šāda pamatinformācija.



Darījumu partneris A ir finanšu darījumu partneris, kas identificēts ar LEI 12345678901234500000

Darījumu partneris B ir Francijas finanšu darījumu partneris, kas identificēts ar LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST

Darījumu partneris C ir NFC, kas ir MVU un identificēts ar LEI 123456789ABCDEFGHIJK

Darījumu partneris D ir identificēts ar LEI 11223344556677889900

Mākleris (brokeris) E ir identificēts ar LEI 88888888888888888888

Koordinējošais aizdevējs F ir identificēts ar LEI BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB

Trīspusējais pārstāvis G ir identificēts ar LEI 77777777777777777777

Turētājbanka H ir identificēta ar LEI AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA

Trešā persona I sniedz ziņošanas pakalpojumus un ir identificēta ar LEI 12345123451234512345

Darījumu partneris J darbojas arī kā tīrvērtes dalībnieks un ir identificēts ar LEI CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC

PVKIU fonds K ir identificēts ar LEI UUUUUUUUUU1111111111, turpretim PVKIU apsaimniekošanas uzņēmums L ir identificēts ar LEI UUUUUUUUUU2222222222

AIF M ir identificēts ar LEI AAAAAAAAAA1111111111, turpretim AIF apsaimniekošanas uzņēmums N ir identificēts ar LEI AAAAAAAAAA2222222222

CDP O ir identificēts ar LEI BBBBBBBBBB1111111111

Vācijas vērtspapīru emitents ir identificēts ar LEI NNNNNNNNNNNNNNNNNNNN

Spānijas vērtspapīru emitents ir identificēts ar LEI EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE

Francijas vērtspapīru emitents ir identificēts ar LEI FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF

Nīderlandes vērtspapīru emitents ir identificēts ar LEI DDDDDDDDDDDDDDDDDDDD

Itālijas vērtspapīru emitents ir identificēts ar LEI IIIIIIIIIIIIIIIIIIIII

Galvenais vērtspapīru emitents ir identificēts ar LEI GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG

Francijas pamatindeksa vērtspapīru emitents ir identificēts ar LEI 529900S21EQ1BO4ESM68

Tirdzniecības vieta P ir identificēta ar TIK "XWAR"

Vērtspapīri ir identificēti ar šādiem ISIN numuriem:

- a. Vācijas obligācijas (parastās): DE0010877643

- b. Spānijas beztermiņa obligācijas: ES0010877643
- c. Francijas obligācijas: FR0010877643
- d. Nīderlandes obligācijas: NL0010877643
- e. Francijas pamatindeksa akcijas: FR0000120271
- f. Citi Francijas vērtspapīri: FR0010877000
- g. Nodrošinājuma grozs: GB00BH4HKS39
- h. Nodrošinājuma 1. komponente: IT00BH4HKS39
- i. Nodrošinājuma 2. komponente: FR00BH4HKS39

Vērtspapīri ir klasificēti ar šādiem CFI kodiem:

- a. Valdības parastā obligācija: DBFTFR
- b. Valdības beztermiņa obligācija: DBFTPR
- c. Akcijas: ESVUFN

Tabulu lauki, kas nav aizpildīti un ir iekrāsoti pelēkā krāsā, nav attiecināmi uz šiem konkrētajiem piemēriem, tomēr tiek parādīti skaidrības labad.

Ir iekļauta izmantošanas gadījumu piemērojamība dažāda veida VFD. Tiek raksturota arī faktiskā ziņošana saskaņā ar ISO 20022 XML shēmām.

## 5.1 Darījumu partnera dati

172. Pēc VFD tīrvērtēšanas katram darījumu partnerim tīrvērtes dalībnieka laukā jānorāda savs tīrvērtes dalībnieks.
173. Ja notiek brīvprātīga ziņošanas deleģēšana vai atbildības sadalīšana, ziņojuma iesniedzējai struktūrai vai par ziņošanu atbildīgajai struktūrai atsevišķi jāiesniedz darījumu partnera dati, kā arī aizdevuma un nodrošinājuma dati par katru no abām paziņotajām pusēm.
174. Ja izmantošanas gadījumi attiecas uz diviem vai vairākiem turpmāk minētajiem izmantošanas gadījumiem, ziņojošajiem darījumu partneriem vai par ziņošanu atbildīgajām struktūrām jāiekļauj visa attiecīgā informācija, pamatojoties uz turpmāk sniegtajiem norādījumiem.

**7. tabula. Izmantošanas gadījumi**

	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. tabula. Izmantošanas gadījumi**

	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 Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp galvenajiem uzņēmumiem**

175. 8. tabula parāda, kāda veida vērtspapīru finansēšanas darījumus var veikt tikai divpusēji, starp diviem galvenajiem uzņēmumiem.

**8. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu**

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

176. 9. tabula ilustrē ziņošanu par divpusēju darījumu, kad ziņojošais darījumu partneris (darījumu partneris A) pats iesniedz savus ziņojumus (t. i., nav atsevišķas ziņojuma iesniedzējas struktūras). Darījumu partneris A ir arī šā darījuma saņēmējs un CVD dalībnieks.

9. tabula. Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp galvenajiem uzņēmumiem			
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>1234567890123450000</LEI> </RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		<LEI>1234567890123450000</LEI>
7	Branch of the reporting counterparty		</Id>
8	Branch of the other counterparty		<Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
9	Counterparty side	GIVE	</FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Sd>GIVE</Sd> </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>1234567890123450000</LEI>
15	Broker		</NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData> <SttlmPties>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>1234567890123450000</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		</SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData>

9. tabula. Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp galvenajiem uzņēmumiem			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.1.2 Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp filiālēm

10. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

177. 11. tabula parāda piemēru ziņošanai par divpusēju darījumu, kas noslēgts starp divu darījumu partneru filiālēm. Juridiskās personas (galvenie uzņēmumi) ir identificētas ar attiecīgiem LEI, savukārt filiāļu valstis ir identificētas ar ISO valstu kodiem. Darījumu partneris A ir arī CVD dalībnieks.

11. tabula. Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp filiālēm			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; </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	FR	

11. tabula. Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD starp filiālēm			
No	Field	Example	XML Message
8	Branch of the other counterparty	DE	<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Ntr> <Brnch> <Ctry>FR</Ctry>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</Brnch> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
12	Country of the other Counterparty	FR	<OthrCtrPty> <Id>
13	Beneficiary		<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI>
14	Tri-party agent		</Id> <Brnch>
15	Broker		<Ctry>DE</Ctry>
16	Clearing member		</Brnch> <CtryCd>FR</CtryCd>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
18	Agent lender		<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>  <LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>  <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData>  ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

### 5.1.3 Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD ar saņēmējiem

12. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

178. 13. tabula parāda divpusēja ne-tīrvērtēta darījuma piemēru, kurā darījumu partneris A nav šā darījuma saņēmējs. Saņēmējs ir darījumu partneris D. Darījumu partneris A ir arī CVD dalībnieks.

13. tabula. Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD ar saņēmējiem			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;Ntr&gt; &lt;FI&gt; &lt;Clssfctn&gt;CDTI&lt;/Clssfctn&gt; &lt;/FI&gt; &lt;/Ntr&gt; &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;CtryCd&gt;FR&lt;/CtryCd&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt; </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	{LEI} of counterparty D	



13. tabula. Ne-tīrvērtēti divpusēji VFD ar saņēmējiem			
No	Field	Example	XML Message
14	Tri-party agent		<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <Bnfcry>
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<LEI>11223344556677889900</LEI> </Bnfcry> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.1.4 Ne-tīrvērtēti VFD ar mākleriem (brokeriem), veicot norēķinus ar turētājbanku

14. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

179. Scenārijā, kas ilustrēts 15. tabulā, darījumu partneris A noslēdz darījumu ar darījumu partneri B. Darījumu partneris A izmanto turētājbanku H, kas tādēļ tiek norādīta 1.17. laukā. Turklāt darījumu partneris A izmanto māklera (brokera) E pakalpojumus.

**15. tabula. Ne-tīrvērtēti VFD ar mākeriem (brokeriem), veicot norēķinus ar turētājbanku**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-0115:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <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		<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr>
18	Agent lender		<SttlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData>

**15. tabula. Ne-tīrvērtēti VFD ar mākleriem (brokeriem), veicot norēķinus ar turētājbanku**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     ... &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     ... &lt;/CollData&gt;     ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.1.5 Ne-tīrvērtēts VFD ar mākleri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi

**16. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu**

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

180. Scenārijā, kas ilustrēts 17. tabulā, darījumu partneris A noslēdz darījumu ar darījumu partneri B. Darījumu partneris A izmanto koordinējošā aizdevēja F un trīspusējā pārstāvja G pakalpojumus. Turklāt darījumu partneris A izmanto māklera (brokera) E pakalpojumus. Darījumu partneris A ir CVD dalībnieks.

**17. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD ar mākleri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi**

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

**17. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD ar mākli (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi**

No	Field	Example	XML Message
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>
9	Counterparty side	GIVE	</FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<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> <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>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData>

**17. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.1.6 Ne-tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai.

**18. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumus**

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

181. Scenārijā, kas ilustrēts 19. tabulā, darījumu partneris A noslēdz darījumu ar darījumu partneri B. Darījumu partneris A izmanto koordinējošā aizdevēja F un trīspusējā pārstāvja G pakalpojumus. Turklāt darījumu partneris A izmanto māklēra (brokera) E un turētājbankas H pakalpojumus. Visbeidzot, darījumu partneris A deleģē ziņošanu trešai personai I.

**19. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	

**19. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD ar mākeri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai**

No	Field	Example	XML Message
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345123451234512345</LEI>
6	Additional sector classification		</RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty>
7	Branch of the reporting counterparty		<Id>
8	Branch of the other counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
9	Counterparty side	GIVE	<Ntr> <FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Cllsfctn>CDTI</Cllsfctn> </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>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of Broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<TrptyAgt>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>  <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>  <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr>  <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData>

**19. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     ...     &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     ...     &lt;/CollData&gt;     ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.1.7 Tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi

**20. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu**

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

182. 21. tabula ilustrē to, kā aizpildāmi ziņojuma lauki tīrvērtēta VFD gadījumā. Lauku aizpildīšana nav atkarīga no tā, kāda veida piekļuve CDP ir darījumu partnerim. Tajos vienmēr jānorāda struktūra, kas darbojas kā tīrvērtes dalībnieks.

183. Darījumu partneris A piekļūst CDP ar tīrvērtes dalībnieka J starpniecību. Viņš izmanto arī māklēra (brokera) E, koordinējošā aizdevēja F un trīspusējā pārstāvja G pakalpojumus. Darījumu partneris A ir arī CVD dalībnieks.

184. Jāatzīmē, ka CDP lauks attiecas uz 2. tabulu (aizdevuma un nodrošinājuma dati), tādēļ tā aizpildīšana ir apskatīta 5.2. punktā.

**21. tabula. Tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi**

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





**21. tabula. Tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB &lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     ...   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   ...   &lt;/CollData&gt;    ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.1.8 Tīrvērtēts VFD ar māklēri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai.

**22. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu**

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

185. Līdzīgi kā iepriekšējā piemērā, 23. tabula ilustrē ziņojuma lauku aizpildīšanu, ja VFD ir tīrvērtēts un darījumu partneris A piekļūst CDP ar tīrvērtes dalībnieka J starpniecību. Viņš izmanto arī māklēra (brokera) E, koordinējošā aizdevēja F un trīspusējā pārstāvja G pakalpojumus. Turklāt šajā piemērā darījuma norēķini tiek veikti ar struktūru H, kas atšķiras no jebkura cita darījumu partnera, un ziņojošais darījumu partneris deleģē ziņošanu trešai personai I.

186. Jāatzīmē, ka lauku aizpildīšana nav atkarīga no tā, kāda veida piekļuve CDP ir darījumu partnerim. Tajos vienmēr jānorāda struktūra, kas darbojas kā tīrvērtes dalībnieks.

**23. tabula. Tīrvērtēts VFD ar mākeri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty>
6	Additional sector classification		<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI>
8	Branch of the other counterparty		</Id>
9	Counterparty side	GIVE	<Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
13	Beneficiary		<CtryCd>FR</CtryCd>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<OthrPtyData> <TrptyAgt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<LEI>77777777777777777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>88888888888888888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb> <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI>

**23. tabula. Tīrvērtēts VFD ar mākeri (brokeri), koordinējošo aizdevēju un trīspusēju pārstāvi, veicot norēķinus ar CVD dalībnieku, kas nav neviena no šīm struktūrām, un brīvprātīga ziņošanas deleģēšana trešai personai**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/ClrMmb&gt; &lt;SttlmPties&gt; &lt;CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;  &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt; &lt;/CntrlSciesDpstryPtcpt&gt; &lt;/SttlmPties&gt; &lt;AgtLndr&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.1.9 Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds

24. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

187. 25. tabula attēlo PVKIU fonda K noslēgta VFD ziņošanu. Saskaņā ar VFDR 4. panta 3. punktu PVKIU apsaimniekošanas uzņēmums L ir atbildīgs par ziņojumu sniegšanu PVKIU vārdā, tādēļ tas ir norādīts abos laukos — “2.2. Ziņojuma iesniedzēja struktūra” un “2.10. Par ziņošanu atbildīgā struktūra”. Darījuma norēķini tiek veikti ar turētājbanku H.

25. tabula. Ne-fīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New>
2	Report submitting entity	{LEI} of UCITS management company L	... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-
3	Reporting counterparty	{LEI} of UCITS K	01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	UCIT	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		<LEI>UUUUUUUUUU1111111111</LEI>
7	Branch of the reporting counterparty		</Id> <Ntr>
8	Branch of the other counterparty		<FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn>
9	Counterparty side	GIVE	</FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		<LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
15	Broker		<OthrPtyData>
16	Clearing member		<StlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </StlmPties>
18	Agent lender		</OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ...

25. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.1.10 Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds, un PVKIU apsaimniekošanas uzņēmums deleģē ziņošanu trešai personai

26. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

188. 27. tabula attēlo PVKIU fonda K noslēgta VFD ziņošanu. Saskaņā ar VFDR 4. panta 3. punktu PVKIU apsaimniekošanas uzņēmums L ir atbildīgs par ziņojumu sniegšanu PVKIU vārdā, tādēļ tas ir norādīts 2.10. laukā "Par ziņošanu atbildīgā struktūra", tomēr tas nolemj deleģēt ziņošanu trešai personai I, kas tiek norādīta 2.2. laukā "Ziņojuma iesniedzēja struktūra". Darījuma norēķini tiek veikti ar turētājbanku H.

27. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;12345123451234512345&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;UUUUUUUUUUU1111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;Ntr&gt; </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		

27. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis PVKIU fonds			
No	Field	Example	XML Message
9	Counterparty side	GIVE	<FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	</FI> </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>UUUUUUUUUU2222222222</LEI>
16	Clearing member		</NttyRspnsblForRpt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

### 5.1.11 Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis AIF fonds

28. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

189. 29. tabula attēlo AIF fonda M noslēgta VFD ziņošanu. Saskaņā ar VFDR 4. panta 3. punktu AIF apsaimniekošanas uzņēmums N ir atbildīgs par ziņojumu sniegšanu AIF vārdā, tādēļ tas ir norādīts abos laukos — “2.2. Ziņojuma iesniedzēja struktūra” un “2.10. Par ziņošanu atbildīgā struktūra”. Darījuma norēķini tiek veikti ar turētājbanku H.

29. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis AIF fonds			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;RptgDtTm&gt;2020-01- 01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt;           &lt;RptSubmitgNtty&gt;             &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA2222222222&lt;/LEI&gt;           &lt;/RptSubmitgNtty&gt;           &lt;CtrPtyData&gt;             &lt;RptgCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA1111111111&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;               &lt;Ntr&gt;                 &lt;FI&gt;                   &lt;Clssfctn&gt;AIFD&lt;/Clssfctn&gt;                 &lt;/FI&gt;               &lt;/Ntr&gt;               &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt;             &lt;/RptgCtrPty&gt;             &lt;OthrCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;               &lt;CtryCd&gt;FR&lt;/CtryCd&gt;             &lt;/OthrCtrPty&gt;             &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;               &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA2222222222&lt;/LEI&gt;             &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;             &lt;OthrPtyData&gt;               &lt;SttlmPties&gt;                 &lt;CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;                   &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;                 &lt;/CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;               &lt;/SttlmPties&gt;             &lt;/OthrPtyData&gt;           &lt;/CtrPtyData&gt;         </pre>
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		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of AIF management company N	
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	
18	Agent lender		

29. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, ko noslēdzis AIF fonds			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   ...   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   ...   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.1.12 Ne-tīrvērtēts VFD, kura līdzekļu portfeļa pārvaldīšana ir nodota ārpakalpojumā

190. Ja portfeļa pārvaldību nodod ārpakalpojumā citai struktūrai, kas nav fonda apsaimniekošanas uzņēmums, šī struktūra jāpaziņo tikai kā māklers (brokeris), ja tā darbojas kā tāds. Pretējā gadījumā šī struktūra, tāpat kā citas struktūras, kas var tieši vai netieši piedalīties VFD, nav jāpaziņo nevienā laukā.

191. Scenārijā, kas ilustrēts 31. tabulā, AIF fonda M portfeļa pārvaldība tiek deleģēta citai struktūrai, kas nedarbojas kā māklers (brokeris). Darījuma norēķini tiek veikti ar turētājbanku H.

30. tabula. VFD, kuriem piemēro izmantošanas gadījumu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

31. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, kura līdzekļu portfeļa pārvaldīšana ir nodota ārpakalpojumā			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;   ...   &lt;CtrPtyData&gt;   &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt;   &lt;RptSubmitgNtty&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of AIF management company N	
3	Reporting counterparty	{LEI} of AIF M	
4	Nature of the reporting counterparty	F	



**31. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, kura līdzekļu portfeļa pārvaldīšana ir nodota ārpalpojumā**

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

**31. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD, kura līdzekļu portfeļa pārvaldīšana ir nodota ārpalpojumā**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

## 5.2 Aizdevumu un nodrošinājuma dati

192. Pēc darījumu partnera datu lauku aizpildīšanas jāaizpilda aizdevuma un nodrošinājuma datu lauki dažādiem izmantošanas gadījumiem. Ir paredzēta arī ziņošana saskaņā ar ISO 20002 XML shēmām. Tā atvieglos darījumu partneriem šo lauku aizpildīšanu.

193. Katrā apakšiedaļā būs īss ziņošanas loģikas apraksts attiecībā uz analizētajiem laukiem.

### 5.2.1 Ziņošana par darbības veidiem darījuma līmenī un pozīcijas līmenī

#### 5.2.1.1 Jauns divpusējs ne-tīrvērtēts VFD darījuma līmenī

194. 32. tabula ilustrē to, kā aizpildāmi ziņojuma lauki jauna ne-tīrvērtēta VFD gadījumā. Tā norāda, kā darījuma līmenī jāziņo par divpusēju VFD.

**32. tabula. Jauns ne-tīrvērtēts VFD darījuma līmenī**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;NonClrd&gt;NORE&lt;/NonClrd&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

5.2.1.2 Jauns divpusējs VFD darījuma līmenī, kas ir i) tīrvērtēts tajā pašā dienā ii) vai vēlāk.

195. 33., 34. un 35. tabula ilustrē, kā darījumu partnerim (nevis CDP) jāaizpilda ziņojuma lauki jauna VFD gadījumā, ja darījums i) tiek slēgts divpusēji un pēc tam tīrvērtēts tajā pašā dienā vai ii) tiek tīrvērtēts nākamajā dienā pēc tā noslēgšanas tirdzniecības vietā. Darījumu partneriem jāiesniedz VFD ziņojums ar darbības veidu “ETRM”, kas neļauj aizpildīt lauku “Tīrvērtēts”, lai norādītu pirmstermiņa izbeigšanu darījumam, par kuru ziņots, kā par ne-tīrvērtētu. Pēc tam darījumu partnerim jāiesniedz VFD ziņojums ar darbības veidu “NEWT”, lai norādītu, ka VFD ir tīrvērtēts. Iesniegumu secība ir parādīta attiecīgi 33., 34. un 35. tabulā.

33. tabula. Jauns divpusējs VFD darījuma līmenī, kas ir tīrvērtēts tajā pašā dienā vai vēlāk			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> </RpTrad> <ClrSts> <NonClrd>NORE</NonClrd> </ClrSts> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>TCTN</LvITp> </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

34. tabula. Divpusēja VFD darījuma līmenī izbeigšana saistībā ar tīrvērtēšanu tajā pašā dienā vai vēlāk			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>

**34. tabula. Divpusēja VFD darījuma līmenī izbeigšana saistībā ar tīrvērtēšanu tajā pašā dienā vai vēlāk**

No	Field	Example	XML Message
98	Action type	ETRM	<pre> &lt;Rpt&gt;   &lt;EarlyTermntn&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;     &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;     ...   &lt;/EarlyTermntn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
99	Level		

**35. tabula. Jauns tīrvērtēts VFD darījuma līmenī, kas izriet no divpusēja VFD tīrvērtēšanas tajā pašā dienā vai vēlāk**

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

<sup>8</sup> No tīrvērtes dalībnieka klienta viedokļa, tas nav piemērojams CDP ziņojumam.

**35. tabula. Jauns tīrvērtēts VFD darījuma līmenī, kas izriet no divpusēja VFD tīrvērtēšanas tajā pašā dienā vai vēlāk**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

196. Ņemiet vērā, ka 33. un 34. tabulas ziņojums nav nepieciešams, ja darījumu tirdzniecības vietā ir noslēguši darījumu partneri, kuri ir arī tīrvērtes dalībnieki, un centrālais darījumu partneris ir to tīrvērtējis tajā pašā dienā — tādā gadījumā ir vajadzīgs tikai 35. tabulas ziņojums. Turklāt 35. tabula ilustrē ziņošanu gadījumos, kad tīrvērtētais VFD netiek uzreiz iekļauts pozīcijā (tādā gadījumā tas tiks paziņots ar darbības veidu POSC, kā paskaidrots turpmākajos piemēros).

#### 5.2.1.3 Jauns VFD tiek paziņots kā pozīcijas komponents

197. 36. un 37. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, ja jauns VFD<sup>9</sup> tiek paziņots kā pozīcijas komponents. Šādi var paziņot VFD, kas ir iekļauts CDP tīrvērtētā pozīcijā. Secība, kas parādīta 36. un 37. tabulā, ir mainījusies, ņemot vērā to, ka VFD ir noslēgts tirdzniecības vietā un centrālais darījumu partneris ir to tīrvērtējis tajā pašā dienā, tādēļ jāpaziņo ir tikai VFD tā tīrvērtētajā veidā. Saistībā ar piemēriem, kas attiecas uz CDP tīrvērtētajiem VFD, tie tiek identificēti ar unikālo darījuma identifikatoru (UDI) "PUT11".

198. Tā kā šī iespēja ir papildinājums ziņošanai darījuma līmenī, ziņojumi ir šādi. Darījumu partneriem nav jāpaziņo ziņojuma izsekošanas numurs (2.2. lauks) CDP tīrvērtētiem VFD.

**36. tabula. Jauns VFD, kas noslēgts tirdzniecības vietā un ko centrālais darījumu partneris ir tīrvērtējis tajā pašā dienā, un tas tiek paziņots ar pozīcijas komponentu darījuma līmenī**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;PosCmpnt&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     &lt;RpTrad&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;UnqTradIdr&gt;UT12&lt;/UnqTradIdr&gt;   &lt;ClrSts&gt;   &lt;Clrd&gt;     ... </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	POSC <sup>10</sup>	
99	Level	TCTN	

<sup>9</sup> Tīrvērtētu VFD scenāriji tiek atzīmēti kā tādi, kas ir piemērojami repo darījumiem, lai gan praksē šie scenāriji nav gaidāmi. Maržinālam aizdevumam pozīcijas līmenis nav iespējams.

<sup>10</sup> Ņemiet vērā, ka sākotnējie darījumi darījuma līmenī jāpaziņo ar pozīcijas komponentu kā darbības veidu.

**36. tabula. Jauns VFD, kas noslēgts tirdzniecības vietā un ko centrālais darījumu partneris ir tīrvērtējis tajā pašā dienā, un tas tiek paziņots ar pozīcijas komponentu darījuma līmenī**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/ClrD&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/PosCmpnt&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

**37. tabula. Jauns CDP tīrvērtēts VFD, kas paziņots pozīcijas līmenī**

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

<sup>11</sup> Neraugoties uz izvēles iespēju, divpusēji saskaņotos VFD nevar aizstāt ar vienotu darījumu, tādēļ visi ziņojumi, kas iesniegti pozīcijas līmenī, tiek tīrvērtēti.

<sup>12</sup> Šajā piemērā tiek izveidota jauna pozīcija. Gadījumā, ja tīrvērtēts darījums tiek iekļauts esošā pozīcijā, par to tiek ziņots kā par šīs pozīcijas grozījumu (ar darbības veidu MODI).

<sup>13</sup> Ņemiet vērā, ka iegūtais tīrvērtētais VFD jāpaziņo pozīcijas līmenī, un pozīcijas līmeņa ziņojumus var izmantot tikai kā papildinājumu darījuma līmeņa ziņojumiem, tādēļ tiek prasīts paziņot tabulas 36 un 37.

**37. tabula. Jauns CDP tīrvērtēts VFD, kas paziņots pozīcijas līmenī**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.2.1.4 VFD grozīšana darījuma līmenī

199. 38. tabula ilustrē to, kā aizpildāmi ziņojuma lauki gadījumā, ja tiek grozīts darījuma līmenī iepriekš paziņots VFD.

**38. tabula. VFD grozīšana darījuma līmenī**

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

#### 5.2.1.5 CDP tīrvērtēta VFD grozīšana pozīcijas līmenī

200. 39. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, ja tiek grozīts CDP tīrvērtēts VFD, kas iepriekš paziņots pozīcijas līmenī. Tas tādēļ, ka tika iekļauts papildu VFD, kas noslēgts darījuma līmenī un ko CDP tīrvērtējis tajā pašā vai citā dienā. Pēc darījuma iekļaušanas pozīcijā nav iespējams izmainīt sākotnējo darījuma līmeņa ziņojumu, tomēr, ja kāda informācija ir paziņota kļūdaini, šo VFD var izlabot.

39. tabula. CDP tīrvērtēta VFD grozīšana pozīcijas līmenī			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Mod>
5	Cleared	true	
98	Action type	MODI	
99	Level	PSTN	<CtrPtyData> ... ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>PUTI1</UnqTradldr> <ClrSts> <Clrd> ... </Clrd> </ClrSts> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> <LvITp>PSTN</LvITp> </Mod> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.2.1.6 VFD labošana darījuma līmenī

201. 40. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, ja tiek laboti datu lauki, kas iepriekšējā darījuma līmeņa ziņojumā par VFD tika iesniegti kļūdaini.

40. tabula. VFD labošana darījuma līmenī			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <Crrctn>
98	Action type	CORR	
99	Level	TCTN	<CtrPtyData> ... ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr>



40. tabula. VFD labošana darījuma līmenī			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;       ...       &lt;/CollData&gt;     &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt;   &lt;/Crrctn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.2.1.7 CDP tīrvērtēta VFD labošana pozīcijas līmenī

202. 41. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, ja tiek laboti datu lauki, kas iepriekšējā pozīcijas līmeņa ziņojumā par CDP tīrvērtētu VFD tika iesniegti kļūdaini. Sākotnējais darījuma līmeņa ziņojums nav jālabo, ja tas tika iesniegts pareizs.

41. tabula. CDP tīrvērtēta VFD labošana pozīcijas līmenī			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;Crrctn&gt;         ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;RpTrad&gt;         &lt;UnqTradldr&gt;PUTI1&lt;/UnqTradldr&gt;         &lt;ClrSts&gt;           &lt;Clrd&gt;             ...           &lt;/Clrd&gt;         &lt;/ClrSts&gt;       &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;       ...       &lt;/CollData&gt;     &lt;LvITp&gt;PSTN&lt;/LvITp&gt;   &lt;/Crrctn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	CORR	
99	Level	PSTN	

41. tabula. CDP tīrvērtēta VFD labošana pozīcijas līmenī			
No	Field	Example	XML Message
			</SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.2.1.8 VFD novērtēšana (tikai attiecībā uz SLB)

203. 42. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, ja SLB darījumā tiek atjaunināts vērtspapīru novērtējums. Darījumu partneris aizdevuma vērtspapīrus novērtē 1 000 000 EUR vērtībā, un tas šajā gadījumā sakrīt ar aizdevuma vērtību (2.56. lauks), kas nav piemērojama darbības veidam "VALU". Šajā gadījumā darījumu partneris ziņo par aizdoto vērtspapīru novērtējumu (2.57. lauks) tajā valūtā, kurā izsniegts aizdevums. Tirgus vērtības valūta ir norādīta XML tagā.

42. tabula. VFD novērtēšana (tikai attiecībā uz SLB)			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <ValtnUpd>  <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <MktVal Ccy="EUR">1000000</MktVal> </LnData>  <CollData> ... </CollData> ... </ValtnUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>
57	Market value	1000000	
98	Action type	VALU	

#### 5.2.1.9 Ziņošana par VFD nodrošinājuma informācijas atjauninājumu, kas nodrošināts darījuma līmenī

204. Jebkura informācija par nodrošinājumu jāpaziņo tikai ar darbības veidu COLU, un attiecībā uz VFD, kas nodrošināts darījuma līmenī, jāpaziņo arī nodrošinātā darījuma UDI, kā parādīts 43. tabulā. Nodrošinājuma paziņošanas īpatnības ir apskatītas 5.4. punktā.

205. Šo piemēru var izmantot arī VFD nodrošinājuma paziņošanai pozīcijas līmenī, ja pozīcijai tiek piesaistīts nodrošinājums.

**43. tabula. Ziņošana par VFD nodrošinājuma informācijas atjauninājumu, kas nodrošināts darījuma līmenī**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollUpd&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     &lt;RpTrad&gt;       &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;     &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/CollUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		

206. Turklāt, tiklīdz VFD ir iekļauts pozīcijā, par visiem nodrošinājuma informācijas atjauninājumiem jāziņo saistībā ar šo pozīciju, nevis ar sākotnējo VFD.

#### 5.2.1.10 Ziņošana par VFD nodrošinājuma informācijas atjauninājumu, kas nodrošināts neto riska darījuma līmenī

207. Jebkura informācija par nodrošinājumu jāpaziņo tikai ar darbības veidu COLU, un attiecībā uz VFD, kas nodrošināts neto riska darījuma līmenī, nav nepieciešams nekāds UDI, kā parādīts 44. tabulā. Nodrošinājuma paziņošanas īpatnības ir apskatītas 5.4. punktā.

**44. tabula. Ziņošana par VFD nodrošinājuma informācijas atjauninājumu, kas nodrošināts neto riska darījuma līmenī**

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

**44. tabula. Ziņošana par VFD nodrošinājuma informācijas atjauninājumu, kas nodrošināts neto riska darījuma līmenī**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/TradData&gt; ... &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.2.1.11 VFD pirmstermiņa izbeigšana

208. 45. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, kad tiek izbeigts nenoteikta termiņa VFD vai pirms termiņa tiek izbeigts noteikta termiņa VFD. Līmenis, t. i., darījums vai pozīcija, kurā tiek paziņots VFD, šajā izmantošanas gadījumā nav būtisks, jo 2.99. lauks "Līmenis" šim darbības veidam nav piemērojams.

**45. tabula. VFD pirmstermiņa izbeigšana**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;EarlyTermntn&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/EarlyTermntn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	ETRM	
99	Level		

#### 5.2.1.12 Kļūdains VFD

209. 46. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, kad jāatceļ viss nepareizi iesniegtais ziņojums gadījumā, ja VFD nekad nebija eksistējis vai uz to nebija attiecinātas VFD paziņošanas prasības, bet kļūdas dēļ par šo VFD tika paziņots darījumu reģistram. Līmenis, t. i., darījums vai pozīcija, kurā tiek paziņots VFD, šajā izmantošanas gadījumā nav būtisks, jo 2.99. lauks "Līmenis" šim darbības veidam nav piemērojams.

46. tabula. Kļūdainais VFD darījuma līmenī			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;Err&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/Err&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	EROR	
99	Level		

### 5.3 Aizdevuma dati

210. Nākamajās iedaļās tiks apskatīts, kā aizpildāmi konkrēti lauki ar kopīgām īpatnībām darījuma aizdevuma pusē. Tās ļaus ziņojošajiem darījumu partneriem tiešā veidā novērtēt informāciju, kas tiem attiecīgā gadījumā jāpaziņo par katru konkrēto datu sadaļu.
211. Apstiprināšanas noteikumos ir iekļautas pilnīgas norādes par piemērojamiem laukiem katram VFD veidam, darbības veidam un līmenim, kā arī attiecīgās sakarības.
212. Visi turpmāk minētie piemēri un izmantošanas gadījumi satur nejauši izveidotus kodus, no kuriem neviens neattiecas uz vērtspapīru vai struktūru.

#### 5.3.1 Notikuma datuma paziņošana

213. Darījumu partneriem jāpatur prātā, ka informācijai, kas paziņota par kādu konkrētu notikuma datumu, jāļauj iestādēm iegūt skaidru priekšstatu par riska darījumiem, kas izriet no kāda konkrēta VFD (vai vairākiem VFD) tās dienas beigās, uz kuru VFD ir attiecināms. Darījumu partneriem jāpaziņo notikuma datums saskaņā ar 4.9.6. punktu.

#### 5.3.2 Tīrvērtēta/ ne-tīrvērtēta VFD paziņošana

##### 5.3.2.1 Tīrvērtētu VFD atklāts piedāvājums

214. Ja darījums tiek tīrvērtēts, izmantojot atklāta piedāvājuma modeli, tīrvērtē notiek VFD noslēgšanas brīdī.
215. 47. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki iepriekš minētajā situācijā no CDP O un tīrvērtes dalībnieka-klienta viedokļa, jo šajā gadījumā tie ir identiski.

216. Jāaizpilda šādu ziņojuma lauku grupa:

- “Tīrvērtēts” (2.5. lauks), ierakstot šajā laukā “pareizs”;
- “Tīrvērtes laika spiedogs” (2.6. lauks) ir vienāds ar 2.12. lauku “Izpildes laika spiedogs”;
- “CDP” (2.7. lauks) ir ierakstīts LEI, kas piešķirts CDP O.

47. tabula. No CDP un tīrvērtes dalībnieka viedokļa			
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> <ClrSts> <Clrd> <CCP>
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtls>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtls> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

### 5.3.2.2 Tīrvērtēts VFD novācījas modelī

217. Ja darījums tiek tīrvērtēts, izmantojot novācījas modeli, tīrvērtē notiek pēc VFD noslēgšanas.
218. 48. un 49. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki no attiecīgi CDP O un tīrvērtēšanas dalībnieka viedokļa gadījumā, kad CDP O tīrvērtē VFD novācījas modelī.
219. Tādējādi jāpaziņo šāda ziņojuma lauku grupa:
- “Ziņojuma izsekošanas numurs” (2.2. lauks) jāpaziņo ar iepriekšējo UDI (divpusēja darījuma gadījumā, ja CDP ir tīrvērtējis VFD), bet to drīkst darīt tikai tīrvērtēšanas dalībnieks un viņa klients (nevis CDP);
  - “Tīrvērtēts” (2.5. lauks), ierakstot šajā laukā “pareizs”;
  - “Tīrvērtēšanas laika spiedogs” (2.6. lauks) atbilst 2.12. laukam “Izpildes laika spiedogs”;
  - “CDP” (2.7. lauks) ir ierakstīts LEI, kas piešķirts CDP O.

48. tabula. Tīrvērtēts VFD novācījas modelī no CDP viedokļa			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;Clrd&gt; &lt;CCP&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB1111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/CCP&gt; &lt;ClrDtTm&gt;2020-04- 22T16:41:07Z&lt;/ClrDtTm&gt; &lt;/Clrd&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;CCPClearingCondition s&lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt; </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	

48. tabula. Tīrvērtēts VFD novācījas modelī no CDP viedokļa			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     ...     &lt;/CollData&gt;     ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

220. 49. tabula parāda piemēru no tīrvērtēšanas dalībnieka viedokļa. Tādā pašā veidā lauki jāaizpilda arī no klienta viedokļa.

49. tabula. Tīrvērtēts VFD novācījas modelī no tīrvērtēšanas dalībnieka viedokļa			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     &lt;RpTrad&gt;     &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTradIdr&gt;     &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt;     &lt;ClrSts&gt;     &lt;Clrd&gt;     &lt;CCP&gt;     &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB1111111111&lt;/LEI&gt;     &lt;/CCP&gt;     &lt;ClrDtTm&gt;2020-04- 22T16:41:07Z&lt;/ClrDtTm&gt;     &lt;RptTrckgNb&gt;UTI1&lt;/RptTrckgNb&gt;     &lt;/Clrd&gt;     &lt;/ClrSts&gt;     &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;     &lt;OthrMstrAgrmtDtIs&gt;CCPClearingCondition s&lt;/OthrMstrAgrmtDtIs&gt; </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	



**49. tabula. Tīrvērtēts VFD novācījas modelī no tīrvērtes dalībnieka viedokļa**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     ...     &lt;/CollData&gt;     ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.2.3 CDP tīrvērtēts VFD piegādes pēc vērtības (DBV) modelī

221. Ja darījums tiek tīrvērtēts, izmantojot DBV modeli, tīrvērtē notiek pēc VFD noslēgšanas.
222. 2.19. laukā jānorāda, vai par darījumu ir veikts norēķins, izmantojot piegādes pēc vērtības mehānismu.
223. 50. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki no CDP O viedokļa. Tādējādi jāpaziņo šāda ziņojuma lauku grupa:
- “Tīrvērtēts” (2.5. lauks), ierakstot šajā laukā “pareizs”;
  - “Tīrvērtes laika spiedogs” (2.6. lauks) atbilst 2.12. laukam “Izpildes laika spiedogs”;
  - “CDP” (2.7. lauks) ir ierakstīts LEI, kas piešķirts CDP O.

**50. tabula. CDP viedoklis**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTradIdr&gt;   &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt;   &lt;ClrSts&gt;   &lt;Clrd&gt;   &lt;CCP&gt;     &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB1111111111&lt;/LEI&gt;   &lt;/CCP&gt; </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. tabula. CDP viedoklis

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;ClrDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ClrDtTm&gt; &lt;/ClrD&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;CCPClearingConditions&lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;DlvryByVal&gt;true&lt;/DlvryByVal&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;  &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ...  &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

51. tabula. Tīrvērtes dalībnieka viedoklis

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	
2	Report tracking number	UTI1	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04-22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;ClrD&gt; &lt;CCP&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB1111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/CCP&gt; &lt;ClrDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ClrDtTm&gt; </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	
19	Delivery by Value ("DBV") indicator	true	

**51. tabula. Tīrvērtes dalībnieka viedoklis**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;RptTrckgNb&gt;UT11&lt;/RptTrckgNb&gt;   &lt;/Clrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;    &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;CCPClearingConditions&lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt;     &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;DlvryByVal&gt;true&lt;/DlvryByVal&gt;     &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.3.2.4 Ne-tīrvērtēts VFD

224. Laukā "Tīrvērtēts" (2.5. lauks) ieraksta "nepareizs", kā norādīts 52. tabulā. Pārējos laukus, kas attiecas uz tīrvērti, neaizpilda. Ieraksta izpildes laika spiedogu.

**52. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	
2	Report tracking number		<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;UnqTradIdr&gt;UT11&lt;/UnqTradIdr&gt;             &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04-22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt; </pre>
5	Cleared	false	
6	Clearing timestamp		
7	CCP		
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	

52. tabula. Ne-tīrvērtēts VFD			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.3 Tirdzniecības vieta

225. Lauku “Tirdzniecības vieta” (2.8. lauks) aizpilda atbilstoši VFD noslēgšanas veidam. Darījumu partneriem vienmēr jāizmanto segments TIK (tirgus identifikācijas kods).
226. Ja VFD slēdz automatizētās tirdzniecības sistēmās (ATS) vai mākleru (brokeru) saskaņošanas platformā, jānorāda minētās platformas TIK. Šajā laukā nevar ierakstīt LEI numuru.

### 5.3.4 Jumta līguma iedaļa

#### 5.3.4.1 Dokumentēts VFD ar jumta līgumu no saraksta

227. Izmantojot jumta līgumu, jāpaziņo šādi lauki:
- “Jumta līguma veids” (2.9. lauks);
  - “Jumta līguma redakcija” (2.11. lauks), ja 2.9. laukā ieraksta lielumu, kas nav “BIAG”, “CSDA” vai “OTHR”.
228. Ja jumta līgumam (izņemot “BIAG”, “CSDA” vai “OTHR”) nav redakcijas, darījumu partneriem laukā “Jumta līguma redakcija” jāieraksta gads, kurā viņi parakstījuši līgumu.
229. VFD, kam piemēro CVD kļūmes novēršanas programmas, jāpaziņo ar jumta līguma veidu “CSDA”.
230. 53. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad VFD noslēdz saskaņā ar GMRA 2011 jumta līgumu.

53. tabula. Dokumentēts VFD ar jumta līgumu no saraksta			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	GMRA	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; </pre>
10	Other master agreement type		
11	Master agreement version	2011	

53. tabula. Dokumentēts VFD ar jumta līgumu no saraksta			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;Vrsn&gt;2011&lt;/Vrsn&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;       ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.3.4.2 Dokumentēts VFD ar līgumu, kas nav sarakstā

231. Ja izmanto jumta līgumu, kas nav sarakstā (piemēram, CDP tīrvērtes nosacījumus novācības darījumiem vai divpusējus specializēta māklera (brokera) līgumus drošības rezerves aizdevumos), jāpaziņo šādi lauki:

- “Jumta līguma veids” (2.9. lauks);
- “Cits jumta līguma veids” (2.10. lauks), ja 2.9. laukā paziņo “OTHR”.

232. 54. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad VFD slēdz saskaņā ar jumta līgumu, kas nav sarakstā, un atsaucas uz CDP O “Repo darījumu noteikumu rokasgrāmatu”.

54. tabula. Dokumentēts VFD ar līgumu, kas nav sarakstā			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	OTHR	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       &lt;LnData&gt;         ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;/Rpt&gt;     &lt;MstrAgrmt&gt;       &lt;Tp&gt;         &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;       &lt;/Tp&gt;       &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;CCP O Repo Rulebook&lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt;     &lt;/MstrAgrmt&gt; </pre>
10	Other master agreement type	CCP O Repo Rulebook	
11	Master agreement version		

54. tabula. Dokumentēts VFD ar līgumu, kas nav sarakstā

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     ...     &lt;/CollData&gt;     ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.3.4.3 Nedokumentēts VFD

233. Nedokumentēta VFD gadījumā jāpaziņo šādi lauki (skatīt 55. tabulu):

- “Jumta līguma veids” (2.9. lauks), kurā ieraksta “OTHR”;
- “Cits jumta līguma veids” (2.10. lauks), kurā ieraksta “Nedokumentēts”.

55. tabula. Nedokumentēts VFD

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	OTHR	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     &lt;RpTrad&gt;     &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
10	Other master agreement type	Undocumented	
11	Master agreement version		

### 5.3.5 Darījuma noslēgšana un uzsākšana

234. Turpmāk sniegtie divi piemēri ilustrē ziņošanu par VFD noslēgšanu, kas a) sākas tūlīt un b) ar valutēšanas dienu nākotnē.
235. Valutēšanas diena jāizprot kā norēķinu datums, par kuru panākta vienošanās saskaņā ar definīciju RTS 2.13. laukā. Par pagaidu nenotikušu norēķinu plānotajā valutēšanas dienā nav jāsniedz nekāds papildu ziņojums (piemēram, "Grozījums"), ja vien darījumu partneri nevienojas grozīt vai izbeigt darījumu nenotikuša norēķina dēļ (tādā gadījumā ir attiecīgi jāpaziņo grozījuma vai izbeigšanas notikums).

#### 5.3.5.1 Tūlītējs VFD

236. 56. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad darījums tiek izpildīts un sākas divu dienu laikā, t. i., atbilstoši norēķinu ciklam ES. Tas ir tūlītējs VFD.

56. tabula. Tūlītējs VFD			
No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt;             &lt;ValDt&gt;2020-04-24&lt;/ValDt&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/New&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
13	Value date (Start date)	2020-04-24	

#### 5.3.5.2 Nākotnes VFD

237. 57. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad darījums sākas vienu mēnesi pēc noslēgšanas; tas nozīmē, ka šis ir nākotnes VFD.

57. tabula. Nākotnes VFD			
No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt; </pre>

57. tabula. Nākotnes VFD			
No	Field	Example	XML Message
13	Value date (Start date)	2020-05-22	<pre> &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;RpTrad&gt;         &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 22T16:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt;         &lt;ValDt&gt;2020-05-22&lt;/ValDt&gt;       &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;       ...     &lt;/CollData&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.6 VFD termiņš

238. Paziņojot minimālo informēšanas periodu (2.16. lauks), darījumu partneriem jāiesniedz informācija par darbadienām saskaņā ar darbadienas definīciju attiecīgajā jumta līgumā vai divpusējā līgumā, kas regulē VFD darbību.
239. Ja šo lauku piemēro tādiem VFD, kuru izvēles iespējamība nav paredzēta TS par ziņošanu, piemēram, atsavināmiem repo darījumiem, darījumu partneriem jāpaziņo informācija par agrāko atsaukšanas datumu (2.17. lauks), ja tā ir pieejama.
240. Darījumu partneriem jāpaziņo minimālais informēšanas periods (2.16. lauks) nenoteikta termiņa repo darījumiem, t. i., ierakstot 2.21. laukā "pareizs", kā arī beztermiņa un pagarināmiem repo darījumiem, t. i., ierakstot 2.22. laukā ETSB vai EGRN.
241. Darījumu partneriem jāaizpilda 2.17. lauks "Agrākais atsaukšanas datums" attiecībā uz tiem VFD, kuriem ir paredzēta izbeigšanas iespēja. Ja vien darījumu partneri nav vienojušies par jaunu agrāko atsaukšanas datumu, viņiem jāpaziņo sākotnējais agrākais atsaukšanas datums, kas piemērojams VFD.

#### 5.3.6.1 Nenoteikta termiņa VFD

242. 58. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad darījumu partneri vienojas par nenoteikta termiņa darījumu ar vienas dienas minimālo informēšanas periodu darījuma izbeigšanai.



58. tabula. Nenoteikta termiņa VFD			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)		<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MinNtcePrd>1</MinNtcePrd> <Term> <Opn>NOAP</Opn> </Term> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>
16	Minimum notice period	1	
17	Earliest call-back date		
21	Open term	true	

#### 5.3.6.2 Noteikta termiņa VFD

243. 59. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad darījumu partneri ir vienojušies 2020. gada 22. maijā apmainīt skaidru naudu, vērtspapīrus vai preces pret nodrošinājumu VFD noslēguma posmam (nākotnes posmam).
244. Minimālais darbadienu skaits piemērā, kurā vienam darījumu partneriem jāinformē otrs darījumu partneris par šā VFD izbeigšanu, ir piecas darbadienas.
245. Agrākais datums, kad naudas aizdevējam ir tiesības atsaukt daļu līdzekļu vai izbeigt darījumu, ir 2020. gada 7. maijs. Kaut arī šāds scenārijs nav ierasta prakse, tas joprojām ir iespējams.

59. tabula. Noteikta termiņa VFD			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)	2020-05-22	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>
16	Minimum notice period	5	
17	Earliest call-back date	2020-05-07	
21	Open term	false	

59. tabula. Noteikta termiņa VFD			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;MinNtcePrd&gt;5&lt;/MinNtcePrd&gt; &lt;EarlstCallBckDt&gt;2020-05- 07&lt;/EarlstCallBckDt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;/New&gt; &lt;Mod&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;Term&gt; &lt;Fxd&gt; &lt;MtrtyDt&gt;2020-05- 22&lt;/MtrtyDt&gt; &lt;/Fxd&gt; &lt;/Term&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/Mod&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.7 Izbeigšanas iespējamība

246. ESMA norāda, ka darījumu partneriem jāpaziņo 2.22. lauks ar vienu no šādiem lielumiem — "EGRN", "ETSB" vai "NOAP". 2.21. laukā jāieraksta viens no diviem — "pareizs" vai "nepareizs". Ja 2.22. lauks "Izbeigšanas iespējamība" ir aizpildīts ar "ETSB", šajā laukā ieraksta "nepareizs".

247. Ja VFD ir atsaucams vai atsavināms, darījumu partneriem šī informācija jāpaziņo laukā "Agrākais atsaukšanas datums" (2.17. lauks).

### 5.3.8 Vispārīgie un īpašie nodrošinājuma mehānismi

248. Lauks "Vispārējais nodrošinājuma rādītājs" (2.18. lauks) attiecas tikai uz vērtspapīriem, kas iesniegti kā nodrošinājums, nevis uz vērtspapīriem, kas tiek aizdoti.

249. Saskaņā ar RTS un atbilstoši MMSR izmantotajiem ziņošanas norādījumiem, "GENE" jāpaziņo visos gadījumos, kad nodrošinājuma sniedzējs var izvēlēties vērtspapīrus, ko iesniegt kā nodrošinājumu, no visiem tiem vērtspapīriem, kas atbilst iepriekš noteiktiem kritērijiem. Tas ietver arī, bet ne tikai, vispārējā nodrošinājuma (GC) līnijas, ko nodrošina automatiska tirdzniecības sistēma, piemēram, CDP pārvaldībā, un darījumus, kuros nodrošinājumu pārvalda trīspusējs pārstāvis. "GENE" jābūt arī noklusējuma gadījumam lielākajā daļā SLB mehānismu. "SPEC" jāpaziņo tikai gadījumos, kad nodrošinājuma ņēmējs pieprasa nodrošinājumam īpašu ISIN.
250. Ziņošana par nodrošināšanu neto riska darījumiem (2.73. lauks) ir atsevišķs jautājums, kas nav tieši saistīts ar nodrošinājuma mehānisma veidu. Darījumi, kas notiek vispārējā nodrošinājuma (GC) platformā, var tikt nodrošināti vai nu kā atsevišķi darījumi, vai arī kā neto riska darījumi. Darījumu partneriem tie attiecīgi jāpaziņo. Ziņošana par nodrošinājuma groziem ir paskaidrota 5.4.2. punktā par nodrošināšanu.
251. Ja VFD sākotnēji noslēdz kā GC, bet tam ir nodrošinājuma ņēmēja izvēlēti īpaši vērtspapīri, kas piesaistīti pēc izpildes, VFD nekavējoties kļūst par īpašu nodrošinājuma darījumu. VFD ziņojums ar darbības veidu "MODI" jāpaziņo ar grozītu lielumu 2.18. laukā, un attiecīgais nodrošinājums jāpaziņo ar darbības veidu "COLU".
252. Ja vien darījumu partneri nevienojas citādi, trīspusēji repo darījumi jāpaziņo 2.18. laukā "Vispārējais nodrošinājuma rādītājs", aizpildot to ar "GENE".
253. 60., 61. un 62. tabula sniedz trīs piemērus par to, kā aizpildīt lauku "Vispārējais nodrošinājuma rādītājs" (2.18. lauks). Ņemiet vērā, ka tie var neaptvert visus esošos gadījumus.

#### 5.3.8.1 Īpašs nodrošinājums, nododot īpašumtiesības

254. 60. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad uz VFD attiecas īpašs nodrošinājuma mehānisms (2.18. lauks, kas aizpildīts ar SPEC) un šis nodrošinājums ir saistīts ar īpašumtiesību nodošanu (2.20. lauks, kas aizpildīts ar TTCA).

60. tabula. Īpašs nodrošinājums, nododot īpašumtiesības			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	SPEC	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;GnlColl&gt;SPEC&lt;/GnlColl&gt;             &lt;DivryByVal&gt;false&lt;/DivryByVal&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollDivryMtd&gt;TTCA&lt;/CollDivryMtd&gt;         &lt;/RpTrad&gt;       &lt;/LnData&gt; </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

60. tabula. Īpašs nodrošinājums, nododot īpašumtiesības			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.8.2 Vispārējs nodrošinājums ķīlas gadījumos

255. 61. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad uz VFD attiecas vispārējs nodrošinājuma mehānisms (2.18. lauks, kas aizpildīts ar GENE) un šis nodrošinājums ir saistīts ar vērtspapīru finansiālās nodrošināšanas mehānismu (2.20. lauks), kas aizpildīts ar SICA.

61. tabula. Vispārējs nodrošinājums ķīlas gadījumos			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;GnlColl&gt;GENE&lt;/GnlColl&gt; &lt;DlvryByVal&gt;&gt;false&lt;/DlvryByVal&gt; </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	SICA	<pre> &lt;CollDlvryMtd&gt;SICA&lt;/CollDlvryMtd&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; ... &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.8.3 DBV vispārējs nodrošinājums, nododot īpašumtiesības

256. 62. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad uz VFD attiecas vispārējs nodrošinājuma mehānisms (2.18. lauks, kas aizpildīts ar GENE) un šis nodrošinājums ir saistīts ar īpašumtiesību nodošanu (2.20. lauks, kas aizpildīts ar TTCA). Par darījumu norēķinās, izmantojot DBV mehānismu (2.19. lauks), kas aizpildīts ar PAREIZS.

62. tabula. DBV vispārējs nodrošinājums, nododot īpašumtiesības			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;GnlColl&gt;GENE&lt;/GnlColl&gt; &lt;DivryByVal&gt;true&lt;/DivryByVal&gt; </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	true	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

### 5.3.9 Fiksētas vai mainīgas likmes

257. Noslēdzot VFD, darījumu partneri var vienoties par fiksētas procentu likmes vai mainīgas procentu likmes izmantošanu VFD aizdevuma pusē. Negatīvi lielumi ir atļauti laukā "Fiksētā likme" (2.23. lauks) un laukā "Koriģētā mainīgā likme" (2.35. lauks).

258. Paziņojot mainīgās likmes, darījumu partneriem jānorāda attiecīgā likme un piemērojamais intervāls. Darījumu partneriem šī informācija jāatjaunina tikai tad, kad viņi vienojas izmainīt likmi vai intervālu, bet ne katru dienu.

259. Vairākas mainīgās likmes, piemēram, ESTER, SOFR u. c., tika noteiktas pēc tam, kad tika publicēti RTS un ITS par ziņošanu. Tām ir ISO kods. Darījumu partneriem jāizmanto jau saskaņotie kodi, lai iesniegtu informāciju konsekventāk. Ja ir citas mainīgās likmes, kurām nav ISO koda, darījumu partneriem jāpaziņo saskaņots burtciparu kods.

260. Darījumu partneriem 2.35. lauks "Koriģētā likme" un 2.36. lauks "Likmes datums" jāpaziņo tikai par iepriekš saskaņotām likmes izmaiņām nākotnē, kas paredzētas, darījumu noslēdzot. Pārējās fiksētās vai mainīgās likmes izmaiņas jāpaziņo attiecīgi 2.23. un 2.25. laukā.
261. Darījumu partneri 2.23. vai 2.25. laukā nepaziņo nekādas likmes, kas saistītas ar īstermiņa tirgus vērtību (2.71. lauks).

#### 5.3.9.1 Fiksētās likmes sākotnējais ziņojums

262. Ja darījumu partneri noslēdz VFD ar fiksētām likmēm, viņiem jāaizpilda 2.23. un 2.24. lauks, kā parādīts 63. tabulā. Šajā gadījumā gada procentu likme ir "-0,23455" ar dienu skaita konversiju kā "Actual360" ("A004").

63. tabula. Fiksētās likmes sākotnējais ziņojums			
No	Field	Example	XML Message
1	UTI	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;IntrstRate&gt; &lt;Fxd&gt; &lt;Rate&gt;-0.23455&lt;/Rate&gt; &lt;DayCntBsis&gt; &lt;Cd&gt;A004&lt;/Cd&gt; &lt;/DayCntBsis&gt; &lt;/Fxd&gt; &lt;/IntrstRate&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
23	Fixed rate	-0.23455	
24	Day count convention	A004	
98	Action type	NEWT	

### 5.3.9.2 Fiksētās likmes grozījums

263. Ja darījumu partneri vienojas grozīt fiksēto likmi, t. i., pārvērtēt VFD, viņiem jāpaziņo šis grozījums 2.23. laukā un 2.24. laukā, kā parādīts 64. tabulā. Šajā gadījumā jaunā gada procentu likme ir "0,12345" ar jaunu dienu skaita konversiju kā "Actual365Fixed" ("A005").

64. tabula. Fiksētās likmes grozījums			
No	Field	Example	XML Message
1	UTI	UTI1	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;Mod&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;&lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;             &lt;IntrstRate&gt;               &lt;Fxd&gt;                 &lt;Rate&gt;0.12345&lt;/Rate&gt;                 &lt;DayCntBsis&gt;                   &lt;Cd&gt;A005&lt;/Cd&gt;                 &lt;/DayCntBsis&gt;               &lt;/Fxd&gt;             &lt;/IntrstRate&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/Mod&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
23	Fixed rate	0.12345	
24	Day count convention	A005	
98	Action type	MODI	

### 5.3.9.3 Mainīgās likmes sākotnējais ziņojums

264. 65. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki, ja darījumu partneri ir noslēguši VFD, par standarta likmi izvēloties EONIA (25. lauks) ar mainīgās likmes atsauces periodu, kas izteikts dienās (2.26. lauks), un ar vesela skaitļa reizinātāju vienas dienas laika periodam (2.27. lauks).
265. Darījumu partneri ir arī vienojušies par vienas nedēļas laika periodu attiecībā uz mainīgās likmes maksājumu biežumu (2.28. lauks), ar vesela skaitļa reizinātāju vienas nedēļas laika periodam (2.29. lauks), aprakstot, cik bieži darījumu partneri apmainās ar maksājumiem.
266. Šajā gadījumā mainīgā likme tiks atiestatīta, pamatojoties uz dienu laika periodu (2.30. lauks), ar vienas dienas reizinātāju (2.31. lauks).

267. Šajā gadījumā pamatpunktu skaits, kas jāpieskaita (vai jāatskaita, ja lielums ir negatīvs — šajā laukā tas ir pieļaujams) kā intervāls mainīgajai procentu likmei, lai noteiktu aizdevuma procentu likmi, ir “5” (2.32. lauks).

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

#### 5.3.9.4 Mainīgās likmes koriģēšanas lauki

268. Mainīgās likmes korekcijas ir jāpaziņo, kā par to ir vienojušies darījumu partneri. Negatīvi lielumi ir atļauti.



### 5.3.10 Repo darījumi un BSB/SBB pamatsummas

269. 73. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad pamatsumma valutēšanas dienā ir 10 162 756,90 EUR un pamatsumma termiņa beigās ir 10 161 551,48 EUR.
270. Ja pamatsummas lielums termiņa beigās (2.38. lauks) vēl nav zināms, apstiprināšanas noteikumi ļauj šo lauku atstāt tukšu. Šis lauks vēlāk jāatjaunina, kad lielums ir zināms.
271. Kritēriju gadījumā termiņa beigās plānotā pamatsumma ir jāpaziņo ziņošanas laikā un jāatjaunina, tiklīdz kļūst zināms par kādu atkāpi.

66. tabula. Repo darījumi un BSB/SBB pamatsummas			
No	Field	Example	XML Message
37	Principal amount on the value date	10162756.90	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;PrncplAmt&gt;               &lt;ValDtAmt                 Ccy="EUR"&gt;10162756.9&lt;/ValDtAmt&gt;               &lt;MtrtyDtAmt                 Ccy="EUR"&gt;10161551.48&lt;/MtrtyDtAmt&gt;             &lt;/PrncplAmt&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/New&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
38	Principal amount on the maturity date	10161551.48	
39	Principal amount currency	EUR	

### 5.3.11 Aizdevuma puse, aizdodot vērtspapīrus

272. SLB darījumos katra darījuma aizdevuma puse ir saistīta ar vērtspapīru, kas konsekventi jānovērtē ziņojošajiem darījumu partneriem. "Vērtspapīra vai preces cena" (2.49. lauks) jāpaziņo valūtā, kurā izteikta šā vērtspapīra vai preces cena. Šī valūta jānorāda laukā "Cenas valūta" (2.50. lauks). Turklāt vērtspapīra cenā nedrīkst iekļaut nekādas maržinālas prasības, atlaides, uzcenojumus, papildinājumus utt., kuri toties ir jāpaziņo kā daļa no nodrošinājuma tirgus vērtības (2.88. lauks), pat ja tos aprēķina no darījuma aizdevuma puses.

273. 2.46. laukā “Daudzums vai nominālsumma” šī nominālsumma jāpaziņo tikai obligācijām. Nominālsumma jāpaziņo sākotnējā valūtā, kas norādīta laukā “Nominālsummas valūta” (2.48. lauks). Citiem vērtspapīriem jāpaziņo daudzums, un tādā gadījumā jāaizpilda lauks “Mērvienība” (2.47. lauks), bet lauks “Nominālsummas valūta” (2.48. lauks) jāatstāj tukšs.
274. “Aizdevuma vērtība” tiek aprēķināta valūtā, kurā vērtspapīrs ir izteikts saskaņā ar turpmāk sniegto formulu, nevis valūtā, kurā abi darījumu partneri ir noslēguši darījumu. Tomēr “Tirgus vērtība” atbilst darījumu partneru veiktajam aizdevuma vērtspapīru novērtējumam. Šis novērtējums var būt izteikts citā valūtā, nevis tajā, kurā izteikts aizdevuma nodrošinājums. Skatīt arī piemēru 5.2.1.8. punktā.
275. Aizdevuma vērtību aprēķina šādi:

***Aizdevuma vērtība (2.56. lauks)=***

*Daudzums vai nominālsumma (2.46. lauks) \* Vērtspapīra vai preces cena (2.49. lauks)*

276. Var būt gadījumi, kad aizdevuma vērtspapīru (vai vērtspapīru, ko izmanto kā nodrošinājumu) novērtēšana nav iespējama, jo nav pieejama informācija par cenu. Tas attiecas, piemēram, uz apturētām akcijām vai dažiem fiksēta ienākuma vērtspapīriem nelikvīdu tirgus segmentos. Noslēdzot VFD, kas saistīts ar šādu vērtspapīru izmantošanu, darījumu partneriem jāpaziņo novērtējums, par kuru panākta vienošanās līgumā. Ja kļūst pieejama jauna informācija par cenu, abiem darījumu partneriem jāpaziņo novērtējuma atjauninājumi laukā “Tirgus vērtība” (2.57. lauks).

## 5.3.12 Vērtspapīri

### 5.3.12.1 Vērtspapīra/ nodrošinājuma kvalitāte

277. Lauki “Vērtspapīra kvalitāte” (2.51. lauks) un “Nodrošinājuma kvalitāte” (2.90. lauks) ziņojošajām struktūrām jāaizpilda ar vienu no lielumiem, kas norādīti ĪTS par ziņošanu.
278. Lielums “NOAP” jāizmanto šādiem nodrošinājuma veidiem (2.94. lauks) — pamatindeksa akcijas (MEQU), citas akcijas (OEQU) un citi aktīvi (OTHR), kuriem nav piemērojami kredītreitingi Regulas (EK) Nr. 1060/2009 (KRAR) nozīmē<sup>14</sup>. Lielums “NOTR” jāizmanto tikai instrumentiem, kurus var novērtēt, bet kuriem nav kredītreitinga.
279. Lai paziņotu šo informāciju un lai nebūtu mehāniski jāpaļaujas uz kredītreitingiem saskaņā ar KRA regulas 5.a pantu, darījumu partneriem jāizmanto vērtspapīru kredītkvalitātes iekšējais novērtējums, kas var ietvert ārējus vērtējumus, kurus veikusi viena vai vairākas KRA.

---

<sup>14</sup> Saskaņā ar KRAR 3. pantu “kredītreitings” ir atzinums par juridiskas personas kredītpēju, par parādu vai finanšu saistībām, parāda vērtspapīriem, priekšrocību akcijām vai citiem finanšu instrumentiem vai par šādu parādu vai finanšu saistību, parāda vērtspapīru, priekšrocību akciju vai cita finanšu instrumenta emitentu, un šo atzinumu izsniedz, izmantojot ieviestu un noteiktu kredītreitingu kategoriju klasifikācijas sistēmu.

280. Paziņotajai vērtībai pēc iespējas precīzāk jāatbilst vērtspapīra īpašībām. Ja, aizpildot 2.51. lauku, tiek izmantoti ārēji vērtējumi, darījumu partneriem vislabāk būtu sava novērtējuma pamatā likt nevis emitenta reitingu, bet instrumenta reitingu, ja tas ir pieejams. Valūtas denominācijai (vietējā vai ārvalstu valūta) un termiņam (īstermiņa vai ilgtermiņa) jāatbilst vērtspapīra īpašajām iezīmēm.
281. Darījumu partneriem jāiesniedz pēc iespējas konsekventāka informācija par vērtspapīra kvalitāti, jo tā tiks izmantota saskaņošanai. Tomēr ESMA ir informēta par iespējamiem ierobežojumiem, kas varētu liegt struktūrām dalīties ar šo informāciju; šādā gadījumā ziņojošajiem darījumu partneriem jāpaziņo lielums, kas visvairāk atbilst iekšējam novērtējumam.

### 5.3.12.2 Obligācijas

282. Obligāciju gadījumā cena jānorāda procentos, nevis decimāldaļās no 1.
283. 67. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad VFD ir saistīts ar ieguldījumu kategorijas valsts vērtspapīriem un tiek klasificēts kā parāda instruments (obligācijas) ar nominālvērtību 100 000 000 EUR.
284. Šajā piemērā vērtspapīrus emitēja Vācijas emitents (2.53. lauks), kas identificēts ar LEI (2.54. lauks).
285. Vērtspapīra cena tiek izteikta procentos kā 99,5 % (2.49. lauks), valūta ir eiro (2.50. lauks), un vērtspapīru termiņa datums ir 2030. gada 22. aprīlis (2.50. lauks).
286. VFD aizdevuma lielums ir 99 500 000 EUR (2.56. lauks), un aizņēmējam nav ekskluzīvas iespējas aizņemties no aizdevēja vērtspapīru portfeļa (2.68. lauks).

67. tabula. Obligācijas			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;SctiesLndg&gt;           &lt;AsstTp&gt;             &lt;Scty&gt;               &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;             &lt;/Scty&gt;           &lt;/AsstTp&gt;         &lt;/SctiesLndg&gt;       &lt;/LnData&gt;     &lt;/TradData&gt;     &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;     &lt;QtyOrNmnlVal&gt;       &lt;NmnlVal&gt;         &lt;Amt           Ccy="EUR"&gt;100000000&lt;/Amt&gt;         &lt;/NmnlVal&gt;       &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt;           </pre>
41	Security identifier	{ISIN}	
42	Classification of a security	{CFI}	
46	Quantity or nominal amount	100000000	
48	Currency of nominal amount	EUR	
49	Security or commodity price	99.5	
50	Price currency		
51	Security quality	INVG	
52	Maturity of the security	2030-04-22	
53	Jurisdiction of the issuer	DE	





**68. tabula. Pamatindeksa akcijas**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   ...   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.3.12.4 Citi vērtspapīri bez termiņa

293. 69. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad VFD ir saistīts ar vērtspapīriem, kuri nav iekļauti sarakstā, kas sniegts ĪTS I pielikuma 2.55. laukā. Šajā gadījumā 2.55. laukā jāieraksta "Citi aktīvi". Vērtspapīru daudzums ir 100 000 (2.46. lauks). 2.48. lauks nav piemērojams, jo 2.46. laukā ir ierakstīts daudzums, nevis nominālsumma.
294. Aktīvu veids arī šoreiz ir vērtspapīrs (2.40. lauks), un tas ir klasificēts kā ESVUFN (2.42. lauks). Šāda veida vērtspapīriem vērtspapīra kvalitāte nav piemērojama (2.51. lauks).
295. Šajā piemērā vērtspapīrus emitēja Francijas emitents (2.53. lauks), kas identificēts ar LEI (2.54. lauks).
296. Vērtspapīra cena ir izteikta vienībās, un šajā piemērā tā ir 99,5 EUR (2.49. lauks un 2.50. lauks). Vērtspapīriem nav vērtspapīru termiņa datuma, tādēļ 2.52. lauks jāaizpilda ar ISO 8601 standartu "9999-12-31".
297. VFD aizdevuma lielums ir 9 950 000 EUR (2.56. lauks), un aizņēmējam nav ekskluzīvas iespējas aizņemties no aizdevēja vērtspapīru portfeļa (2.68. lauks).

**69. tabula. Citi vērtspapīri bez termiņa**

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



70. tabula. VFD, kas saistīts ar precēm			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	COMM	<SctiesFincgRptgTxRpt>
43	Base product	NRGY	<TradData>
44	Sub - product	OIL	<Rpt>
45	Further sub - product	BRNT	<New>
46	Quantity or nominal amount	100000	...
47	Unit of measure	BARL	<CtrPtyData>
49	Securities or commodities price	60	...
50	Price currency	USD	</CtrPtyData>
56	Loan value	6000000	<LnData>
			<SctiesLndg>
			<AsstTp>
			<Cmmdty>
			<Clssfctn>
			<Nrgy>
			<Oil>
			<BasePdct>NRGY</BasePdct>
			<SubPdct>OILP</SubPdct>
			<AddtlSubPdct>BRNT</AddtlSubPdct>
			</Oil>
			</Nrgy>
			</Clssfctn>
			<Qty>
			<Val>100000</Val>
			<UnitOfMeasr>BARL</UnitOfMeasr>
			</Qty>
			<UnitPric>
			<MntryVal>
			<Amt Ccy="USD">60</Amt>
			</MntryVal>
			</UnitPric>
			</Cmmdty>
			</AsstTp>
			<LnVal Ccy="USD">6000000</LnVal>
			</SctiesLndg>
			</LnData>
			<CollData>
			...
			</CollData>
			...



**70. tabula. VFD, kas saistīts ar precēm**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.3.14 Skaidras naudas atlaide SLB darījumos

301. 71. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad darījumu partneri ir vienojušies par mainīgu atlaides likmi, pamatojoties uz EONIA indeksu (2.59. lauks), ar mainīgās atlaides likmes atsauces periodu, kas izteikts dienās (2.60. lauks), un ar vesela skaitļa reizinātāju vienas dienas laika periodam (2.61. lauks).
302. Darījumu partneri ir arī vienojušies par mainīgās atlaides likmes maksājumiem ar vienas nedēļas biežumu (2.62. lauks) un (2.63. lauks). Ņemiet vērā, ka abi šie lauki nav obligāti, tie ir paredzēti tādu darījumu atvieglošanai, kas nenosaka mainīgās atlaides likmes maksājumu biežumu.
303. Mainīgā likme tiks atiestatīta, pamatojoties uz dienu laika periodu (2.64. lauks), ar vienas dienas reizinātāju (2.65. lauks).
304. Pamatpunktu skaits, kas jāpieskaita (vai jāatskaita, ja lielums ir negatīvs — šajā laukā tas ir pieļaujams) kā intervāls mainīgajai procentu likmei, lai noteiktu aizdevuma procentu likmi, ir "5" (2.66. lauks).

**71. tabula. Skaidras naudas atlaide SLB darījumos**

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

71. tabula. Skaidras naudas atlaide SLB darījumos			
No	Field	Example	XML Message
65	Floating rebate rate reset frequency - multiplier	1	<pre> &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt; &lt;/Term&gt; &lt;PmtFrqcy&gt; &lt;Unit&gt;WEEK&lt;/Unit&gt; &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt; &lt;/PmtFrqcy&gt; &lt;RstFrqcy&gt; &lt;Unit&gt;DAYS&lt;/Unit&gt; &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt; &lt;/RstFrqcy&gt; &lt;BsisPtSprd&gt;5&lt;/BsisPtSprd&gt; &lt;/Fltg&gt; &lt;/RbtRate&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/TxLnData&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/TradData&gt; ... &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
66	Spread of the rebate rate	5	

### 5.3.15 SLB darījumi ar noteiktu maksu — bezskaidras naudas nodrošinājuma SLB, naudas kopfonda SLB un nenodrošināts SLB

305. SLB darījumi ar noteiktu maksu aptver trīs dažādus SLB veidus — bezskaidras naudas nodrošinājuma SLB, naudas kopfonda SLB un nenodrošinātu SLB. Visiem trim veidiem ir viena un tā pati ziņošanas loģika.
306. 72. tabula satur lielumu, kas darījumu partneriem jāpaziņo 67. laukā “Aizdevuma maksa”, noslēdzot bezskaidras naudas nodrošinājuma, naudas kopfonda vai nenodrošinātu SLB (bezatlaides SLB). Aizdevuma maksa šajā gadījumā ir 1,23456 %, un tā ir ierakstīta bez procentu zīmes, kas ir rezervēta XML birkām.

72. tabula. Bezskaidras naudas nodrošinājums			
No	Field	Example	XML Message
67	Lending fee	1.23456	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; </pre>

**72. tabula. Bezskaidras naudas nodrošinājums**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;SctiesLndg&gt;   &lt;LndgFee&gt;1.23456&lt;/LndgFee&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;       ...       &lt;/CollData&gt;       ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.16 Maržinālā aizdevuma summa un īstermiņa tirgus vērtība

307. Kopējā nenokārtotā maržinālā aizdevuma summa (2.69. lauks) jāpaziņo kā nulle (ja klientam ir vispārējs skaidras naudas kredīts/ ilgtermiņa skaidras naudas kredīts) vai kā pozitīvs lielums (ja klientam ir vispārējs skaidras naudas debets/ īstermiņa skaidras naudas debets pamatvalūtā). Pamatvalūta vienmēr ir jāpaziņo, kā noteikts divpusējā līgumā starp specializēto māklēri (brokeri) un viņa klientu.
308. Kopējo maržinālā aizdevuma lielumu aprēķina, pamatojoties uz atsevišķajām maržinālā aizdevuma sastāvdaļām katrā valūtā (2.33. un 2.34. lauks). Šie lauki jāatkārto tik reižu, cik nepieciešams, lai iekļautu visas kontā izmantotās valūtas. Tas ļaus iestādēm uzraudzīt klienta skaidras naudas debetu (t. i., maržinālos aizdevumus) atsevišķās valūtās, nevis tikai neto debetu pamatvalūtā, kā arī skaidras naudas kredītu atsevišķās valūtās, ko izmanto kā nodrošinājumu. Atbilstoši kopējai maržinālā aizdevuma summai klienta neto debets katrā valūtā jāpaziņo kā pozitīvs lielums kopā ar valūtu, savukārt klienta neto kredīts jāpaziņo kā negatīvs lielums.
309. Īstermiņa tirgus vērtība vienmēr jānorāda kā vērtība, kas izteikta maržinālā aizdevuma pamatvalūtā, kā noteikts divpusējā līgumā (2.70. lauks). Paredzams, ka katram UDI tiks aprēķināta viena naudas summa, tādēļ īstermiņa tirgus vērtība dienas beigās jāpaziņo kā neto lielums. Nenokārtota maržināla aizdevuma gadījumā visi neto naudas kredīti, kas izmantoti īstermiņa tirgus vērtības nodrošināšanai, jāpaziņo kā negatīvi lielumi (2.33. lauks) kopā ar valūtu (2.34. lauks).
310. Ja maržināla aizdevuma summa ir nulle, t. i., ja klientam ir neto naudas kredīts pamatvalūtā, un arī īstermiņa tirgus vērtība ir nulle, 2.33., 2.69. un 2.71. laukā jāieraksta nulle. Jāpaziņo arī "nulles" nodrošinājuma informācijas atjauninājums, kā paskaidrots 5.4.4. punktā.

#### 5.3.16.1 Pozitīvās un negatīvās bilances dažās valūtās un neto debets pamatvalūtā

311. 73. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, ja neto debets ir pamatvalūtā, šajā konkrētajā piemērā raksturojot kredītu USD un debetu GBP un EUR. Vienkāršības labad šajā piemērā USD-EUR un GBP-EUR maiņas kurss ir noteikts kā 1.

73. tabula. Pozitīvās un negatīvās bilances dažās valūtās un debets pamatvalūtā			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;MrgnLndg&gt;           &lt;OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR"&gt;150000&lt;/OutsdngMrgnLnAmt&gt;           &lt;ShrtMktValAmt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/ShrtMktValAmt&gt;           &lt;MrgnLnAttr&gt;             &lt;Amt&gt;               &lt;Amt Ccy="USD"&gt;- 100000&lt;/Amt&gt;               &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;50000&lt;/Amt&gt;               &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/Amt&gt;             &lt;/Amt&gt;           &lt;/MrgnLnAttr&gt;         &lt;/MrgnLndg&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </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	

### 5.3.16.2 Neto kredīts pamatvalūtā un īstermiņa tirgus vērtība

312. 74. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki, ja neto naudas kredīts ir pamatvalūtā (GBP), tādēļ nenokārtotais maržinālais aizdevums tiek paziņots kā nulle, bet naudas kredītu ne-pamatvalūtā (USD) klients izmanto kā nodrošinājumu, lai segtu daļu no īstermiņa tirgus vērtības.

74. tabula. Kredīts pamatvalūtā un pozitīva īstermiņa tirgus vērtība			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt; </pre>
34	Margin lending currency	USD	

74. tabula. Kredīts pamatvalūtā un pozitīva īstermiņa tirgus vērtība			
No	Field	Example	XML Message
69	Outstanding margin loan	0	... <CtrPtyData>
70	Base currency of outstanding margin loan	GBP	... </CtrPtyData> <LnData>
71	Short market value	500000	<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> </SciesFincgRptgTxRpt>

### 5.3.16.3 Neto kredīts pamatvalūtā un nav īstermiņa tirgus vērtības

313. 75. tabula ilustrē, kā aizpildāmi ziņojuma lauki gadījumos, kad naudas kredīts ir pamatvalūtā (EUR) un nav īstermiņa tirgus vērtības. Tā kā nav nenokārtota maržināla aizdevuma vai īstermiņa tirgus vērtības, naudas kredīts nav jāpaziņo (jo to neizmanto kā nodrošinājumu maržinālā aizdevumā vai īstermiņa tirgus vērtībā). Tomēr ir nepieciešams ziņojums, lai paziņotu iestādēm par nulles bilanci. Jāieraksta pamatvalūta, kā sākotnēji tika panākta vienošanās sākotnējā līgumā.

75. tabula. Kredīts pamatvalūtā un nav īstermiņa tirgus vērtības			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	0	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData>
34	Margin lending currency	USD	<Rpt> <New>
69	Outstanding margin loan	0	... <CtrPtyData>
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	... </CtrPtyData> <LnData>
71	Short market value	0	<MrgnLndg>

75. tabula. Kredīts pamatvalūtā un nav īstermiņa tirgus vērtības			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/OutsdngMrgnLnAmt&gt; &lt;ShrtMktValAmt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/ShrtMktValAmt&gt; &lt;MrgnLnAttr&gt; &lt;Amt&gt; &lt;Amt Ccy="USD"&gt;0&lt;/Amt&gt; &lt;/Amt&gt; &lt;/MrgnLnAttr&gt; &lt;/MrgnLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

## 5.4 Dati par nodrošinājumu

314. Nākamajās iedaļās tiks apskatīts, kā aizpildāmi konkrēti lauki ar kopīgām VFD nodrošinājuma īpatnībām. Tās ļaus ziņojošajiem darījumu partneriem tiešā veidā novērtēt informāciju, kas tiem katrā konkrētā datu iedaļā jāpaziņo, ja tā ir piemērojama.
315. Apstiprināšanas noteikumos ir iekļautas pilnīgas norādes par piemērojamajiem laukiem katram VFD veidam un darbības veidam, kā arī attiecīgās sakarības.

### 5.4.1 Ziņošana par SLB nodrošināšanu

316. Atkarībā no tā, vai SLB ir nodrošināts vai nenodrošināts, darījumu partneriem šī informācija jāpaziņo 2.72. laukā "Nenodrošinātu vērtspapīru aizdevuma ("SL") atzīme".

#### 5.4.1.1 Nenodrošināts SLB

317. Darījumu partneriem 2.72. laukā "Nenodrošinātu vērtspapīru aizdevuma ("SL") atzīme" jāieraksta "pareizs", ja tas ir nenodrošināts vērtspapīru aizdevums, kas tomēr tiek organizēts kā SLB darījums.

#### 5.4.1.2 Nodrošināts SLB

318. Darījumu partneriem laukā "Nenodrošinātu vērtspapīru aizdevuma ("SL") atzīme" (2.72. lauks) jāieraksta "nepareizs", ja SLB darījums ir nodrošināts vai ja darījumu partneri vienojas par darījuma nodrošināšanu, bet konkrētais nodrošinājuma sadalījums vēl nav zināms.

## 5.4.2 Nodrošināšana

319. Ja ziņošanas brīdī nodrošinājuma grozs nav zināms, 2.96. lauks jāaizpilda ar "NTAV". Tas pats attiecas uz repo darījumiem, kas notiek GC platformās. Tādā gadījumā darījumu partneriem jāatjaunina informācija par nodrošinājuma groza identifikāciju, tiklīdz viņi to uzzina, un pēc tam ne vēlāk kā nākamajā darbadienā pēc valutēšanas dienas jāatjaunina informācija par nodrošinājuma komponentiem.
320. Ja nodrošināšana nenotiek saistībā ar nodrošinājuma grozu, ESMA uzskata, ka darījumu partneriem jāpaziņo attiecīgie nodrošinājuma elementi.

### 5.4.2.1 Vienots darījums ar nodrošinājuma grozu

321. 76. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad divus atsevišķus VFD tirgo ar nodrošinājuma grozu (2.96. lauks), ko identificē ar ISIN "GB00BH4HKS39". Var būt vairāki VFD, kas tiek tirgoti ar nodrošinājuma grozu, tādā gadījumā bez nodrošinājuma neto riska darījumiem. VFD tiek nodrošināti darījuma līmenī (2.73. lauku aizpilda ar "NEPAREIZS").

76. tabula. Vienots darījums ar nodrošinājuma grozu			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; </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')	UTI1	
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	

76. tabula. Vienots darījums ar nodrošinājuma grozu

No	Field	Example	XML Message
1.9	Counterparty side	GIVE	<pre> &lt;UnqTradIdr&gt;UT1&lt;/UnqTradIdr&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt; </pre>
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	FALSE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	<pre> &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;BsktIdr&gt;     &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt;   &lt;/BsktIdr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;Id&gt; </pre>
98	Action type	NEWT	



**76. tabula. Vienots darījums ar nodrošinājuma grozu**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;UnqTradldr&gt;UT12&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;    &lt;Bsktldr&gt;     &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt;   &lt;/Bsktldr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;    ...  &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.2.2 Vienots darījums ar grozu, kura identifikācija ziņošanas brīdī nav zināma

322. 77. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad vienots darījums tiek nodrošināts ar nodrošinājuma grozu, bet ziņošanas brīdī šā groza identifikācija nav pieejama (2.96. lauku aizpilda ar "NTAV").

323. VFD tiek nodrošināts vienota darījuma līmenī (2.73. lauks). VFD tiek nodrošināts darījuma līmenī (2.73. lauku aizpilda ar "NEPAREIZS").

**77. tabula. Vienots darījums bez groza ziņošanas brīdī**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;CtrPtyData&gt;             &lt;RptgCtrPty&gt;               &lt;Id&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	

77. tabula. Vienots darījums bez groza ziņošanas brīdī

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
3	Event date	24/04/2020	<OthrCtrPty> <Id>
9	Master agreement	GMRA	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	</OthrCtrPty> <OthrPtyData>
96	Collateral basket identifier	NTAV	<AgtLndr>
98	Action type	NEWT	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>  <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad>  <NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd>  <Bsktldr> <Id>NTAV</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData>  ...  </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

### 5.4.2.3 Neto riska darījumu nodrošināšana ar grozu

324. 78. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad divi darījumi tiek nodrošināti ar nodrošinājuma grozu (2.96. lauks) neto riska darījumiem (2.73. lauku aizpilda ar "PAREIZS") un identificē ar ISIN "GB00BH4HKS39". Šis piemērs nenozīmē, ka visi GC darījumi notiek kā neto riska darījumi. Darījumu partneriem jāpaziņo VFD uzreiz pēc tā noslēgšanas.
325. Jāpiebilst, ka gadījumos, kad VFD tiek nodrošināti kā neto riska darījumi ar grozu, COLU ziņojumos jānorāda atsevišķi nodrošinājuma komponenti. Groza ISIN jāziņo tikai līdz brīdim, kad tiek noteikta vērtspapīru piesaiste. Nodrošinājuma sastāvdaļas jāpaziņo tādā stāvoklī, kādā tās ir dienas beigās.

78. tabula. Neto riska darījumi ar grozu			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;CtrPtyData&gt;             &lt;RptgCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;             &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt;           &lt;/RptgCtrPty&gt;         &lt;OthrCtrPty&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/OthrCtrPty&gt;         &lt;OthrPtyData&gt;           &lt;AgtLndr&gt;             &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;           &lt;/AgtLndr&gt;         &lt;/OthrPtyData&gt;       &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;RpTrad&gt;         &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt;         &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;         &lt;MstrAgrmt&gt;           &lt;Tp&gt;             &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;           &lt;/Tp&gt;         &lt;/MstrAgrmt&gt;       &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/LnData&gt;   &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
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')	UTI1	
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')	UTI2	

78. tabula. Neto riska darījumi ar grozu

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	</Tp> </MstrAgrmt>
9	Master agreement	GMRA	</RpTrad> </LnData>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<CollData> <RpTrad>
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	NEWT	<Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData>  ... </New> </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>UTI2</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp>

78. tabula. Neto riska darījumi ar grozu			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;Bsktldr&gt; &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt; &lt;/Bsktldr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.2.4 Nodrošināšana neto riska darījumam ar grozu, kura identifikācija ziņošanas brīdī nav zināma

326. 79. tabula ilustrē, kā aizpildāmi lauki gadījumos, kad darījums nav nodrošināts ar nodrošinājuma grozu (2.96. lauku aizpilda ar "NTAV") neto riska darījumiem (2.73. lauku aizpilda ar "PAREIZS").

327. Darījums tiek nodrošināts kā neto riska darījums (2.73. lauks).

79. tabula. Neto riska darījums bez groza ziņošanas brīdī			
No	Field	Example	XML Message
73	Collateralisation of net exposure	true	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;Bsktldr&gt; &lt;Id&gt;NTAV&lt;/Id&gt; &lt;/Bsktldr&gt; </pre>
96	Collateral basket identifier	NTAV	
98	Action type	NEWT	

79. tabula. Neto riska darījums bez groza ziņošanas brīdī			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;  ...  &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.4.3 Naudas nodrošinājums

328. 80. tabula ilustrē, kā jāpaziņo lauki gadījumos, kad SLB darījums ir naudas atlaižu un naudas kopfonda darījums. Šajā piemērā to nodrošina ar naudas nodrošinājumu 1 000 000 EUR apmērā (2.76. lauks un 2.77. lauks). Ziņošana šajā gadījumā notiek tāpat kā darbības veidam “NEWT” un “COLU”.

80. tabula. Naudas nodrošinājums			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	1000000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt;  ...  &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt;  &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Csh&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/Amt&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/AsstTp&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;  ...  &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	

#### 5.4.4 Ziņošana, ja nodrošinājums ir nulle

329. Lai vienkāršotu ziņošanu gadījumos, kad nodrošinājums ir nulle, par nodrošinājumu vienmēr jāziņo kā par naudas nodrošinājumu, kur naudas nodrošinājuma summa ir vienāda ar nulli un nodrošinājuma komponenta veids ir "SKAIDRA NAUDA", neatkarīgi no tā, vai šim VFD iepriekš izmantotais nodrošinājuma veids bija vērtspapīri, preces vai skaidra nauda.
330. 81. tabula ilustrē, kā jāpaziņo lauki gadījumos, kad nodrošinājums ir nulle un nodrošinājuma komponenta veids ir vērtspapīri, preces (tikai repo darījumiem un BSB/SBB darījumiem) vai skaidra nauda.

81. tabula. Ziņošana par nulles nodrošinājumu vērtspapīru, preču un skaidras naudas gadījumā			
No	Field	Example	XML Message
75	Type of collateral component	CASH	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           ...         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;AsstTp&gt;               &lt;Csh&gt;                 &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/Amt&gt;               &lt;/Csh&gt;             &lt;/AsstTp&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/CollData&gt;         ...       &lt;/CollUpd&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
76	Cash collateral amount	0	
77	Cash collateral currency	EUR	

#### 5.4.5 Vērtspapīra nodrošinājuma lauki

331. Attiecībā uz vērtspapīriem, par kuriem informācija nav pieejama, ziņošana ir obligāta līdz valutēšanas dienai +1 diena. Par jautājumiem, kas saistīti ar norēķiniem, skatīt pamatnostādņu 5.4.8. punktu. Attiecībā uz nodrošinājuma groziem, kad informācija tiek paziņota tikai pēc nodrošinājuma piešķiršanas, skatīt pamatnostādņu 5.4.2. punktu.

#### 5.4.5.1 Diskonts

332. Darījumu partneriem jāiesniedz dati par nodrošinājumu saskaņā ar RTS par ziņošanu pielikuma 2. tabulu.
333. Nodrošinājuma tirgus vērtība (2.88. lauks) jānorāda kā patiesā vērtība, izņemot diskontu. Citiem vārdiem, nodrošinājuma tirgus vērtībā jāiekļauj viss nodrošinājuma sniedzēja norādītais nodrošinājums, tostarp nepiesaistītais, bet vēl neapmaksātais nodrošinājums, pirms jebkura diskonta atskaitīšanas.
334. Diskonts vai drošības rezerve (2.89. lauks) jāpaziņo ISIN līmenī kā procenti, par visiem VFD veidiem. Repo darījumiem diskonts tiek noteikts līgumā, un tas jāparedz uz VFD darbības laiku, ja vien darījumu partneri atkārtoti to nepārvērtē. Diskontu aprēķina, no 1 atņemot attiecību starp skaidru naudu un nodrošinājuma vērtību, un tad reizina ar 100. Piemēram, repo darījumam ar 100 skaidrā naudā un 105 kā nodrošinājumu diskonts ir  $100 * [1 - (100/105)] = 4,7619$ , un tas jāpaziņo kā "4,7619". Tos pašus principus piemēro portfeļa līmeņa repo darījumu diskontam (t. i., gadījumā, ja, darījumu partneriem vienojoties, visam repo darījumu nodrošinājuma portfelim tiek piemērots vienots diskonts). Kā norādīts RTS par ziņošanu, portfeļa līmeņa diskonts jāpaziņo arī ISIN līmenī, t. i., tas jāatkārto attiecībā uz katru portfelī esošo ISIN (un attiecībā uz skaidru naudu, ja tā ir portfeļa daļa).
335. SLB gadījumā laukā "Diskonts vai drošības rezerve" (2.89. lauks) jāiekļauj tikai tie diskonti, kas attiecas uz nodrošinājuma pusi. Toties prasības attiecībā uz drošības rezervi tiks izpildītas, izmantojot nodrošinājuma tirgus vērtību (2.88. lauks) un naudas nodrošinājuma summu (2.76. lauks). Tādējādi nodrošinājuma tirgus vērtība un naudas nodrošinājuma summa jāatjaunina, iekļaujot arī visus papildinājumus (piemēram, aizdevuma uzcenojumus), kurus sāk piemērot darījuma laikā.
336. 82. tabula parāda tāda SLB nodrošinājuma datus, kurā vērtspapīri 100 000 EUR vērtībā tiek aizņemti pret 100 000 EUR lielu skaidras naudas nodrošinājumu (2.76. lauks un 2.77. lauks), t. i., bez diskonta, un tas nozīmē, ka diskonts jāpaziņo kā nulle (2.89. lauks).

82. tabula. Naudas nodrošinājums bez diskonta			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	100000	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New>  ... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	



**82. tabula. Naudas nodrošinājums bez diskonta**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Csh&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/Amt&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;/Csh&gt;   &lt;/AsstTp&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

337. 83. tabula parāda aizdotu vērtspapīru 100 000 EUR vērtībā, kas nodrošināts ar 105 000 USD skaidrā naudā (2.76. lauks un 2.77. lauks), un tā ir 105 % drošības rezerve aizdevuma pusē.

**83. tabula. Naudas nodrošinājums ārvalstu valūtā ar drošības rezervi**

No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	105000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     ...     &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     &lt;RpTrad&gt;     &lt;AsstTp&gt;     &lt;Csh&gt;     &lt;Amt Ccy="USD"&gt;105000&lt;/Amt&gt;     &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;     &lt;/Csh&gt;     &lt;/AsstTp&gt;     &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/CollData&gt;     ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	USD	
89	Haircut or margin	0	

338. Piemērā par “jauktu” nodrošinājumu (84. tabula) aizdoti vērtspapīri 100 000 EUR vērtībā ir nodrošināti ar 55 000 EUR naudas nodrošinājumu (2.76. lauks) un 60 000 EUR bezskaidras naudas nodrošinājumu (2.88. lauks). Tas ietver prasību par (nenoteiktu) drošības rezervi aizdevuma pusē, kas attiecas gan uz skaidras naudas, gan bezskaidras naudas nodrošinājumu, un papildus ir noteikts 5 % diskonts to vērtspapīru vērtībai, kurus izmanto kā nodrošinājumu. 2.89. laukā ieraksta “0” attiecībā uz naudas nodrošinājumu un “5” attiecībā uz vērtspapīriem, kurus izmanto kā nodrošinājumu.

84. tabula. “Jaukts” nodrošinājums ar diskontu un drošības rezervi			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	55000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...           &lt;/CtrPtyData&gt;           &lt;LnData&gt;             ...             &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             &lt;RpTrad&gt;               &lt;AsstTp&gt;                 &lt;Scty&gt;                   &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;60000&lt;/MktVal&gt;                 &lt;HrcutOrMrgn&gt;5&lt;/HrcutOrMrgn&gt;               &lt;/Scty&gt;             &lt;Csh&gt;               &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;55000&lt;/Amt&gt;             &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;           &lt;/Csh&gt;         &lt;/AsstTp&gt;       &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/CollData&gt;     ...       &lt;/New&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	
88	Collateral market value	60000	
89	Haircut or margin	5	

339. Negatīvus diskontus var paziņot, ja nodrošinājuma vērtība ir mazāka par aizdevuma vērtību. Diskonta zīmei nav jāatšķiras darījumu partnera pusē.

340. 85. tabula parāda repo darījumu, kas ir nodrošināts ar vērtspapīru grozu (šoreiz bez skaidras naudas), un visiem nodrošinājuma vērtspapīriem tiek piemērots portfeļa līmeņa diskonts. Tāds pats diskonts jāpaziņo par katru portfeļa nodrošinājuma komponentu (tostarp skaidru naudu, ja tā ir daļa no portfeļa). Aizdevums 150 000 EUR vērtībā ir nodrošināts ar diviem vērtspapīriem — ar 110 000 EUR vērtu vērtspapīru A un 50 000 EUR vērtu vērtspapīru B. Norādītā nodrošinājuma kopējā tirgus vērtība ir 160 000 EUR, un tā atbilst portfeļa līmeņa diskontam  $100 * [1 - (150/160)] = 6,25\%$ . Tas ir lielums, kas jāpaziņo 2.89. laukā attiecībā uz katru ISIN. Līdzīgi, attiecībā uz nodrošinājumu neto riska darījumiem (2.73. lauks) par katru atsevišķo vērtspapīru jāpaziņo viens un tas pats diskonts.

85. tabula. Nodrošinājuma portfelis ar portfeļa līmeņa diskontu			
No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	110000	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           ...         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;AsstTp&gt;               &lt;Scty&gt;                 &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;110000&lt;/MktVal&gt;           &lt;/Scty&gt;           &lt;HrcutOrMrgn&gt;6.25&lt;/HrcutOrMrgn&gt;         &lt;/Scty&gt;         &lt;Scty&gt;           &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;50000&lt;/MktVal&gt;           &lt;HrcutOrMrgn&gt;6.25&lt;/HrcutOrMrgn&gt;         &lt;/Scty&gt;         &lt;/AsstTp&gt;         &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/CollData&gt;         ...       &lt;/New&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
89	Haircut or margin	6.25	
88	Collateral market value	50000	
89	Haircut or margin	6.25	

341. Maržinālu aizdevumu gadījumā, ja diskonta vai drošības rezerves prasība attiecas uz visu nodrošinājuma portfeli, 2.89. laukā norādītā vērtība jāatkārto attiecībā uz visiem ISIN un skaidras naudas elementiem. Ja tā nav un diskonti tiek piemēroti katram vērtspapīram citādi, jāpaziņo ar ISIN saistītie diskonti vai drošības rezerves (tādā pašā formātā kā attiecībā uz citiem VFD, t. i., procentos).

#### 5.4.5.2 Nodrošinājuma veids

342. Nodrošinājuma veids (2.94. lauks) darījumu partneriem jāpaziņo ar vienu no šādām vērtībām:

- a. "GOVS" — valdības vērtspapīri;
- b. "SUNS" — pārnacionālu organizāciju un aģentūru vērtspapīri;
- c. "FIDE" — parāda vērtspapīri (tostarp segtās obligācijas), ko emitējušas bankas un citas finanšu iestādes;
- d. "NFID" — uzņēmuma parāda vērtspapīri (tostarp segtās obligācijas), ko emitējušas nefinanšu iestādes;
- e. "SEPR" — vērtspapīroti produkti (tostarp ABS, CDO, CMBS, RMBS un ABCP);
- f. "MEQU" — pamatindeksu akcijas (tostarp konvertējamās obligācijas);
- g. "OEQU" — citas akcijas (tostarp konvertējamās obligācijas);
- h. "OTHR" — citi aktīvi (tostarp akcijas kopieguldījumu fondos).

343. Attiecībā uz citiem vērtspapīriem darījumu partneri var izmantot citus oficiālos avotus, lai samazinātu neatbilstību un saskaņošanas problēmu risku. Definējot valdības vērtspapīrus, ziņojošajām struktūrām attiecībā uz VFD datu vākšanu jāizmanto Finanšu stabilitātes padomes (FSP) standartu 19. zemspītras piezīme un Bāzeles III standartizētā pieeja. Ja uz kādu no darījumu partneriem Bāzeles III prasības neattiecas, darījumu partneriem jāvienojas par vērtību, kas jāpaziņo šajā laukā.

344. Atšķirība starp laukiem "Pamatindeksa akcijas" un "Citas akcijas" atbilst FSP standartiem. Tomēr FSP locekļi paši var lemt par to, kuri indeksi kvalificējami kā "pamatindeksi", ar nosacījumu, ka tie tiek definēti saskaņā ar FSP/BCBS ietvara ieviešanu attiecībā uz diskontiem tajos VFD, kas nav centralizēti tīrvērtēti.

345. ESMA ĪTS par pamatindeksiem un biržās, kas atzītas saskaņā ar Kapitāla prasību regulu (KPR)<sup>15</sup>, ir pieejams pamatindeksu saraksts (I pielikuma 1. un 2. tabula). Sarakstā ir iekļauti akciju un konvertējamo obligāciju indeksi, kas aptver aktīvus ES teritorijā un ārpus tās. Šis saraksts jāizmanto kā atsauce, lai klasificētu akcijas un konvertējamās obligācijas laukos "Pamatindeks" vai "Cits".

---

<sup>15</sup> Komisijas Īstenošanas regula (ES) 2016/1646 (2016. gada 13. septembris).

#### 5.4.5.3 Nodrošinājuma atkalizmantošanas pieejamība

346. Darījumu partneriem jāaizpilda šis lauks, ņemot vērā tikai līgumiskās iespējas atkalizmantot nodrošinājumu. Ja laukā “Metode, ko izmanto nodrošinājuma sniegšanai” (2.20. lauks) tiek ierakstīts “TTCA” vai “SIUR”, “Nodrošinājuma atkalizmantošanas pieejamība” (2.95. lauks) vienmēr jāaizpilda ar “PAREIZS”. Šeit nav jāņem vērā darbības ierobežojumi vai normatīvās prasības, kas var apgrūtināt atkalizmantošanu. Līgumā noteiktās atkalizmantošanas iespējas jāparedz jumta līgumā, kas nosaka VFD izmantotā nodrošinājuma mehānisma veidu.
347. Piemēram, CDP, kas nodod VFD nodrošinājumu no viena tīrvērtes dalībnieka otram saskaņā ar “TTCA”, jāpaziņo, ka nodrošinājums ir pieejams atkalizmantošanai, pat ja CDP tīrvērtes nosacījumi nepieļauj atkalizmantošanu. Tas pats attiecas uz PVKIU — saņemtais bezskaidras naudas nodrošinājums, kas ir pieejams atkalizmantošanai, ir jāpaziņo kā tāds, kaut arī to nevar atkalizmantot saskaņā ar ESMA pamatnostādņēm par ETF un citām PVKIU problēmām.
348. Visbeidzot, ņemiet vērā, ka “Nodrošinājuma atkalizmantošanas pieejamība” nav atkarīga no tā, vai nodrošinājums jau ir vai vēl tikai tiks atkalizmantots. Tikai tad, kad nodrošinājums ir atkalizmantots — un tas ietver aizņemto vērtspapīru izmantošanu saskaņā ar SLB vienošanos —, ir papildus jānosūta atkalizmantošanas ziņojums (skatīt 5.6.1. punktu).

#### 5.4.5.4 Parastās obligācijas

349. 86. tabula ilustrē, kā 2020. gada 24. aprīlī jāpaziņo parastās obligācijas, kas izmantotas kā nodrošinājums.
350. Šajā gadījumā 102 000 000 EUR Vācijas valdības parāda vērtspapīros, kas identificēti ar ISIN “DE0010877643” un klasificēti kā “DBFTFR” ar 2 % diskontu un termiņu 2030. gada 22. aprīlī, tika izmantoti kā nodrošinājums repo darījumā. Šie vērtspapīri bija zināmi un tika paziņoti ziņošanas termiņā, kopā ar pārējo informāciju aizdevuma pusē. Vērtspapīru kvalitāte atbilst ieguldījumu kategorijai “INVG”, un nodrošinājums ir pieejams turpmākai atkalizmantošanai. Tabulā ir apskatīti tikai tie lauki, kas ir būtiski, ziņojot par nodrošinājumu.
351. Nodrošinājuma nominālsummas vai daudzuma valūta nav jānorāda obligāti, bet tā ir jāpaziņo, ja paziņo nominālsummu. Paziņojot daudzumu (piemēram, akcijām), šis lauks nav jāaizpilda.
352. Nodrošinājuma valutēšanas dienas lauks attiecas uz SLB darījumiem tikai saistībā ar iepriekš apmaksātu nodrošinājumu.
353. Vienības cenas definīcijā (2.87. lauks) ir norādīts, ka paziņojamā vērtībā jāiekļauj uzkrātie procenti par procentus nesošajiem vērtspapīriem, t. i., to netīrā cena.

86. tabula. Parastās obligācijas			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
75	Type of the collateral component	SECU	<Rpt> <New>

86. tabula. Parastās obligācijas			
No	Field	Example	XML Message
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> </RpTrad> </CollData>  ...  </New>

86. tabula. Parastās obligācijas			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.5.5 Beztermiņa obligācijas

354. 87. tabula ilustrē, kā jāziņo par 102 000 000 EUR Spānijas valdības beztermiņa obligācijās, kas tiek izmantotas kā nodrošinājums. Piemēro 2 % diskontu. Šie vērtspapīri bija zināmi un tika paziņoti ziņošanas termiņā, kopā ar pārējo informāciju aizdevuma pusē. Vērtspapīru kvalitāte atbilst ieguldījumu kategorijai "INVG", un nodrošinājums ir pieejams atkalizmantošanai. Tabulā ir apskatīti tikai tie lauki, kas ir būtiski, ziņojot par nodrošinājumu.
355. Nodrošinājuma nominālsummas vai daudzuma valūta nav jānorāda obligāti, bet tā ir jāpaziņo, ja paziņo nominālsummu. Paziņojot daudzumu (piemēram, akcijām), šis lauks nav jāaizpilda.
356. Nodrošinājuma valutēšanas dienas lauks attiecas uz SLB darījumiem tikai saistībā ar iepriekš apmaksātu nodrošinājumu.
357. Vienības cenas definīcijā (2.87. lauks) ir norādīts, ka paziņojamā vērtībā jāiekļauj uzkrātie procenti par procentus nesošajiem vērtspapīriem, t. i., to netīrā cena.

87. tabula. Beztermiņa obligācijas			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; &lt;Id&gt;ES0010877643&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTPR&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt; &lt;NmnlVal&gt; </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	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	102	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	2	

87. tabula. Beztermiņa obligācijas			
No	Field	Example	XML Message
90	Collateral quality	INVG	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
91	Maturity date of the security	9999-12-31	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
92	Jurisdiction of the issuer	ES	<UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</UnitPric> <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 Pamatindeksa akcijas

358. 88. tabula ilustrē, kā jāziņo par pamatindeksa akcijām "MEQU", ko izmanto kā nodrošinājumu, šajā gadījumā par kopumā 105 000 000 EUR Francijas CAC40 akcijās ar CFI kodu ESVUFN un ar 5 % diskontu. Šie vērtspapīri bija zināmi un tika paziņoti ziņošanas termiņā, kopā ar pārējo informāciju aizdevuma pusē. Lauku "Nodrošinājuma kvalitāte" aizpilda ar "NOAP", jo reitings šiem vērtspapīriem nav piemērojams. Tie ir pieejami turpmākai atkalizmantošanai.
359. Nodrošinājuma nominālsummas vai daudzuma valūta nav jānorāda obligāti, bet tā ir jāpaziņo, ja paziņo nominālsummu. Paziņojot daudzumu (piemēram, akcijām), šis lauks nav jāaizpilda.



360. Nodrošinājuma valutēšanas dienas lauks attiecas uz SLB darījumiem tikai saistībā ar iepriekš apmaksātu nodrošinājumu.
361. Vienības cenas definīcijā (2.87. lauks) ir norādīts, ka paziņojamā vērtībā jāiekļauj uzkrātie procenti par procentus nesošajiem vērtspapīriem, t. i., to netīrā cena.

88. tabula. Pamatindeksa akcijas			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Scty&gt;   &lt;Id&gt; FR0000120271&lt;/Id&gt;   &lt;ClssfctnTp&gt; ESUVFN &lt;/ClssfctnTp&gt;   &lt;QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;Qty&gt;100000000&lt;/Qty&gt;   &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;UnitPric&gt;   &lt;MntryVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;10.5&lt;/Amt&gt;   &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/UnitPric&gt;   &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;105000000&lt;/MktVal&gt;   &lt;HrcutOrMrgn&gt;5&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qlty&gt;NOAP&lt;/Qlty&gt;   &lt;Mtrty&gt;9999-12-31&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;   &lt;Id&gt;   &lt;LEI&gt;529900S21EQ1BO4ESM68&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;JursdctnCtry&gt;FR&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;MEQU&lt;/Cd&gt; </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	
98	Action type	NEWT	

88. tabula. Pamatindeksa akcijas			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Tp&gt; &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.6 Mainīgā drošības rezerve darījuma līmenī tiem VFD, kas nav centralizēti tīrvērtēti

362. Atsauces uz SLB vai repo darījumiem šajā apakšiedaļā ir paredzētas tikai, lai sniegtu dažādu jumta līgumu piemērus. Tomēr par citiem VFD veidiem, piemēram, BSB/SBB vai VFD, kas saistīti ar precēm, jāziņo, pamatojoties uz tiem pašiem principiem.
363. Turklāt šīs apakšiedaļas piemēri attiecas uz mainīgo drošības rezervi atsevišķu VFD līmenī. Tomēr piemēri nākamajā iedaļā ilustrēs ziņošanu par mainīgo drošības rezervi ar nodrošinājumu neto riska darījumiem.
364. Ja nodrošinājuma komponentiem ir negatīva zīme, kad tie ir daļa no mainīgās drošības rezerves neto riska darījumiem, tas raksturo stāvokli dienas beigās, nevis plūsmu attiecīgajā dienā. Kaut arī skaitliskie lielumi var sakrist, atšķirība ir būtiska. Tādējādi darījumu partneriem dienas beigās attiecīgi jāpaziņo katra nodrošinājuma komponenta stāvoklis. Papildu norādījumi ir iekļauti 373. punktā.
365. Vienkāršības labad turpmākajos piemēros diskontu norāda kā nulli. Darījumu partneriem jāpaziņo diskonts, kas aprēķināts saskaņā ar 5.4.5.1. punktu.

##### 5.4.6.1 SLB mainīgā drošības rezerve ar nodrošinājuma sniedzēja papildu nodrošinājumu tiem pašiem vērtspapīriem

366. 89. tabula ilustrē mainīgās drošības rezerves atjaunināšanu SLB darījumam ar parastajām obligācijām piemērā, kas sniegts 86. tabulā — nodrošinājuma nominālsomas palielinājums par 1 000 099 EUR, kas paredzēts, lai kompensētu obligācijas cenas kritumu no 102 uz 100,99 EUR, kā paziņojis nodrošinājuma sniedzējs. Nodrošinājuma sniedzējam un nodrošinājuma ņēmējam pilnīgi vienādā veidā jāiesniedz informācija par nodrošinājumu, kā norādīts 89. tabulā.

89. tabula. Mainīgās drošības rezerves atjaunināšana SLB darījumam			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt; </pre>

89. tabula. Mainīgās drošības rezerves atjaunināšana SLB darījumam			
No	Field	Example	XML Message
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<CollUpd> ... <CtrPtyData>
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	<LEI>12345678901234500000</LEI>
3	Event date	24/04/2020	</Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id>
75	Type of the collateral component	SECU	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	101000099	</CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		<UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
87	Price per unit	100.99	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	102000000	<Tp>GMSLA</Tp> </Tp>
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </SctiesLndg>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<SctiesLndg> <Collsd>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">101000099</Amt>
98	Action type	COLU	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>

89. tabula. Mainīgās drošības rezerves atjaunināšana SLB darījumam			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;UnitPric&gt;   &lt;Ptrg&gt;100.99&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt; &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;    &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qlty&gt;INVG&lt;/Qlty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;    &lt;/Id&gt;  &lt;JursdctnCtry&gt;DE&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReu se&gt;    &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnI nd&gt;    &lt;/Collsd&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/CollData&gt;    ...   &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.6.2 Repo darījuma mainīgā drošības rezerve ar nodrošinājuma sniedzēja papildu nodrošinājumu tiem pašiem vērtspapīriem

367. 90. tabula ilustrē mainīgās drošības rezerves atjaunināšanu repo darījumam ar parastajām obligācijām piemērā, kas sniegts 86. tabulā — nodrošinājuma nominālsomas palielinājums par 1 000 099 EUR, kas paredzēts, lai kompensētu obligācijas cenas kritumu no 102 uz 100,99 EUR, kā paziņojis nodrošinājuma sniedzējs. Nodrošinājuma sniedzējam un nodrošinājuma ņēmējam pilnīgi vienādā veidā jāiesniedz informācija par nodrošinājumu, kā norādīts 90. tabulā.

90. tabula. Mainīgās drošības rezerves atjaunināšana repo darījumam			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollUpd&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;OthrPtyData&gt;   &lt;AgtLndr&gt;     &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;     &lt;UnqTradldr&gt;UT1&lt;/UnqTradldr&gt;     &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Scty&gt;     &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;     &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;     &lt;QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;NmnlVal&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the 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	
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	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	

90. tabula. Mainīgās drošības rezerves atjaunināšana repo darījumam			
No	Field	Example	XML Message
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<pre> &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;101000099&lt;/Amt&gt; &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt; &lt;Ptrg&gt;100.99&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt; &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt; &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt; &lt;Issr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;  &lt;/Id&gt;  &lt;JursdctnCtry&gt;DE&lt;/JursdctnCtry&gt; &lt;/Issr&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;  ...  &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	COLU	

#### 5.4.6.3 SLB mainīgā drošības rezerve ar to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam

368. 91. tabula ilustrē citādu nodrošinājuma informācijas atjaunināšanu piemērā, kas sniegts 86. tabulā — nodrošinājuma nominālsummas samazinājums par 999 709 EUR, lai kompensētu obligācijas cenas palielinājumu no 102 uz 103,03 EUR, kā paziņojis nodrošinājuma sniedzējs. Nodrošinājuma sniedzējam un nodrošinājuma ņēmējam pilnīgi vienādā veidā jāiesniedz informācija par nodrošinājumu, kā norādīts 91. tabulā.

**91. tabula. SLB mainīgā drošības rezerve ar to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;SctiesLndg&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UT11&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;SctiesLndg&gt; &lt;Collsd&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt; </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	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	99000291	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	103.03	
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	

91. tabula. SLB mainīgā drošības rezerve ar to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam

No	Field	Example	XML Message
94	Collateral type	GOVS	<pre> &lt;NmnlVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;99000291&lt;/Amt&gt; &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt;   &lt;Ptrg&gt;103.03&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt;    &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;    &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;    &lt;/Id&gt;  &lt;JursdctnCtry&gt;DE&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;    &lt;/Collsd&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/CollData&gt;    ...   &lt;/CollUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	



5.4.6.4 Repo darījuma mainīgā drošības rezerve ar to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam

369. 92. tabula ilustrē citādu nodrošinājuma informācijas atjaunināšanu piemērā, kas sniegts 86. tabulā — nodrošinājuma nominālsummas samazinājums par 999 709 EUR, lai kompensētu obligācijas cenas palielinājumu no 102 uz 103,03 EUR, kā paziņojis nodrošinājuma sniedzējs. Nodrošinājuma sniedzējam un nodrošinājuma ņēmējam pilnīgi vienādā veidā jāiesniedz informācija par nodrošinājumu, kā norādīts 92. tabulā.

92. tabula. Repo darījuma mainīgā drošības rezerve ar to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; </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	
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	99000291	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	103.03	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	0	

**92. tabula. Repo darījuma mainīgā drošības rezerve ar to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
90	Collateral quality	INVG	<pre> &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;AsstTp&gt;       &lt;Scty&gt;         &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;       &lt;/Scty&gt;     &lt;/AsstTp&gt;   &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; </pre>
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	<pre> &lt;ClsfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClsfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;NmnlVal&gt;     &lt;Amt       Ccy="EUR"&gt;99000291&lt;/Amt&gt;     &lt;/NmnlVal&gt;   &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;UnitPric&gt;     &lt;Ptrg&gt;103.03&lt;/Ptrg&gt;   &lt;/UnitPric&gt;   &lt;MktVal     Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;   &lt;/MktVal&gt;   &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN     &lt;/LEI&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;JursdctnCtry&gt;DE&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;   &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	COLU	

#### 5.4.7 Mainīgā drošības rezerve VFD, kas nav centralizēti tīrvērtēts, ja nodrošināšana tiek veikta neto riska darījumam

370. Veicot nodrošināšanu neto riska darījumiem, papildus nodrošinājumam, ko apmaina darījuma ietvaros, darījumu partneri var vienoties par nodrošinājumu aizdevumiem, kas tika noslēgti ar tāda paša veida neto jumta līgumu.
371. Tādējādi ir gadījumi, kad dažus no nodrošinājuma komponentiem, kurus neto ir sniedzis nodrošinājuma sniedzējs, nodrošinājuma ņēmējs var atgriezt. Tas tiek darīts vai nu tādēļ, lai pārliecinātos, ka nodrošināto darījumu kopumam nav pārmērīga nodrošinājuma vai arī ka nodrošinājums nepārsniedz kādu diskonta vai drošības rezerves robežu, par kuru var vienoties darījumu partneri.
372. Tāpat ir gadījumi, kad vērtspapīri, kurus atgriež nodrošinājuma ņēmējs, nav tieši tādi paši kā tie vērtspapīri, kurus sākotnēji norādīja nodrošinājuma sniedzējs. Tādā gadījumā ir jānosaka nodošanas virziens, lai varētu pareizi aprēķināt risku un nodrošinājuma līmeni.
373. Tāpēc, lai nodrošinātu konsekventu ziņošanu par nodrošinājumu, veicot nodrošināšanu neto riska darījumiem:
- ja nodrošinājums tiek apmainīts VFD, kas nav centralizēti tīrvērtēts, mainīgās drošības rezerves ietvaros neto riska darījumā starp diviem darījumu partneriem, viņiem XML shēmā jānorāda vērtspapīru summa un tirgus vērtība, kuras zīme atbilst katra vērtspapīra stāvoklim no viņu pašu viedokļa;
  - ja nodrošinājuma sniedzējs pievieno papildu nodrošinājumu kā mainīgo drošības rezervi, viņam jāpaziņo jaunā nodrošinājuma tirgus vērtība neto riska darījumam ar negatīvu zīmi;
  - ja nodrošinājuma ņēmējs atgriež daļu no tā paša papildu nodrošinājuma, kuru jau ir sniedzis kā mainīgo drošības rezervi, viņam jāpaziņo jaunā neto nodrošinājuma tirgus vērtība neto riska darījumam ar pozitīvu zīmi, savukārt nodrošinājuma sniedzējam jāpaziņo jaunā neto nodrošinājuma tirgus vērtība ar negatīvu zīmi;
  - ja nodrošinājuma sniedzējs saņem nodrošinājuma komponentus, kas atšķiras no sākotnēji sniegtajiem nodrošinājuma komponentiem, viņam jāpaziņo šo jauno nodrošinājuma komponentu nodrošinājuma tirgus vērtība ar pozitīvu zīmi;
  - un otrādi, nodrošinājuma ņēmējam jāziņo ar pozitīvu zīmi par nodrošinājuma komponentiem, kas saņemti kā daļa no mainīgās drošības rezerves, un ar negatīvu zīmi — par nodrošinājuma sniedzējam nodotajiem nodrošinājuma komponentiem, kas atšķiras no sākotnēji ņemtajiem nodrošinājuma komponentiem.
374. Šo ziņošanas veidu piemēro tikai COLU ziņojumiem, kuros i) nodrošinājums attiecas uz neto riska darījumiem un ii) attiecībā uz nodrošinājuma komponentiem nav norādīts neviens UDI. Šādi ziņojumi nav piemērojami nodrošinājuma piešķiršanai, kas notiek katram darījumam atsevišķi.
375. Ikreiz, kad tiek nodrošināti neto riska darījumi, darījumu partneriem jānosūta COLU ziņojumi par katru VFD, kas tiek nodrošināts darījuma līmenī, un vienots COLU ziņojums par nodrošinājumu, kas tiek izmantots kā mainīgā drošības rezerve.

#### 5.4.7.1 Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve attiecībā pret SLB naudas kopfondu, kas darījuma līmenī ir nodrošināts ar naudas nodrošinājumu

376. Piemērā, kas sniegts 93. tabulā, SLB sākotnēji tika nodrošināti ar naudas nodrošinājumu (naudas atlaižu SLB), un pēc tam darījumu partneri noteica mainīgo drošības rezervi attiecībā pret naudas kopfondu.
377. Skaidrai naudai parasti nav diskonta, un arī šajā gadījumā tiek uzskatīts, ka drošības rezerve aizdevuma pusē ir nulle. Konkrēti, attiecībā uz diskonti un drošības rezervēm darījumu partneriem jāievēro norādījumi 5.4.4. punkta 5.4.5.1. apakšpunktā.

93. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve attiecībā pret SLB naudas kopfondu, kas darījuma līmenī ir nodrošināts ar naudas nodrošinājumu			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollUpd&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;         &lt;OthrCtrPty&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/OthrCtrPty&gt;         &lt;OthrPtyData&gt;           &lt;AgtLndr&gt;             &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;           &lt;/AgtLndr&gt;         &lt;/OthrPtyData&gt;       &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;SciesLndg&gt;         &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;       &lt;/SciesLndg&gt;     &lt;/LnData&gt;   &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
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')	UT12	

**93. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve attiecībā pret SLB naudas kopfondu, kas darījuma līmenī ir nodrošināts ar naudas nodrošinājumu**

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	</SctiesLndg> </LnData>
9	Master agreement	GMSLA	<CollData> <SctiesLndg>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<Collsd> <AsstTp>
75	Type of the collateral component	CASH	<Scty> </Scty>
76	Cash collateral amount	100000000	<Csh> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
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>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</Rpt> <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>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>  <UnqTradIdr>UT12</UnqTradIdr>

**93. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve attiecībā pret SLB naudas kopfondu, kas darījuma līmenī ir nodrošināts ar naudas nodrošinājumu**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;     &lt;Collsd&gt;       &lt;AsstTp&gt;         &lt;Scty&gt;           &lt;/Scty&gt;         &lt;Csh&gt;           &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000000&lt;/Amt&gt;           &lt;/Csh&gt;         &lt;/AsstTp&gt;       &lt;/Collsd&gt;     &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt;   &lt;CollUpd&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;OthrPtyData&gt;       &lt;AgtLndr&gt;         &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;       &lt;/AgtLndr&gt;     &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; </pre>

**93. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve attiecībā pret SLB naudas kopfonda, kas darījuma līmenī ir nodrošināts ar naudas nodrošinājumu**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;  &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;     &lt;Collsd&gt;       &lt;AsstTp&gt;         &lt;Scty&gt;           &lt;/Scty&gt;         &lt;Csh&gt;           &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;5000000&lt;/Amt&gt;           &lt;/Csh&gt;         &lt;/AsstTp&gt;       &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;     &lt;/Collsd&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/CollData&gt;   ...         &lt;/CollUpd&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.2 Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā

378. 94. tabula parāda nodrošinājumu saistībā ar trim UDI, kas sākotnēji bija nodrošināti katrā darījumā atsevišķi. Tomēr šie trīs repo darījumi tika iekļauti savstarpējā ieskaita kopā, un turpmākajos ziņojumos par nodrošinājumu tika ietverti nodrošinājuma elementi, kas attiecās uz atsevišķiem VFD, kuri identificēti ar attiecīgu UDI, un nodrošinājums, ko izmanto neto riska darījumu nodrošināšanai.

**94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt; </pre>

**94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā**

No	Field	Example	XML Message
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<CollUpd> ...
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	<LEI>12345678901234500000</LEI>
3	Event date	24/04/2020	</Id>
9	Master agreement	GMRA	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
75	Type of the collateral component	SECU	</Id>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
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> </CtrPtyData>
86	Price currency		</CtrPtyData> <LnData>
87	Price per unit	100	<RpTrad>
88	Collateral market value	100000000	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
89	Haircut or margin	0	<UnqTradlDr>UTI1</UnqTradlDr>
90	Collateral quality	INVG	<MstrAgrmt>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<Tp>GMRA</Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Tp>
94	Collateral type	GOVS	</MstrAgrmt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>



**94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

No	Field	Example	XML Message
75	Type of the collateral component	SECU	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	Ccy="EUR">100000000</MktVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Issr> <Id>
86	Price currency		<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</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>
90	Collateral quality	INVG	</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> <Amt
98	Action type	COLU	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI>
3	Event date	24/04/2020	</Id>

**94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā**

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement	GMRA	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</Issr> <Tp>
75	Type of the collateral component	SECU	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
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> <Rpt>
87	Price per unit	100	<CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData>
88	Collateral market value	50000000	<RptgCtrPty> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<Id>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</OthrCtrPty> <OthrPtyData>
94	Collateral type	GOVS	<AgtLndr>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
98	Action type	COLU	</OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<LnData> <RpTrad>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <UnqTradIdr>UTI2/UnqTradIdr> <MstrAgrmt>

**94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

No	Field	Example	XML Message
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	</MstrAgrmt> </RpTrad>
3	Event date	24/04/2020	</LnData> <CollData>
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> <QtyOrNmnlVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	5000000	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
84	Collateral unit of measure		<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
86	Price currency		<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr>
87	Price per unit	100	<Id>
88	Collateral market value	5000000	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
89	Haircut or margin	0	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
90	Collateral quality	INVG	<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	...

**94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

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

**94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

No	Field	Example	XML Message
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
75	Type of the collateral component	SECU	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<MktVal Ccy="EUR">5000000</MktVal>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
84	Collateral unit of measure		
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI>  </Id>
86	Price currency		
87	Price per unit	100	<JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr> <Tp>
88	Collateral market value	2000000	<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	
92	Jurisdiction of the issuer	ES	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</RpTrad> </CollData> ... </CollUpd>
94	Collateral type	GOVS	</Rpt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
98	Action type	COLU	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
			<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI>

94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā

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

94. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā

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

5.4.7.3 Neto riska darījums — SLB mainīgā drošības rezerve, kas nodrošināta ar bezskaidras naudas nodrošinājuma kopfondu, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam

379. 95. tabula ilustrē sarežģītāku nodrošinājuma informācijas atjaunināšanu. Nav nodrošinājuma katram darījumam atsevišķi; sākotnēji noslēgtais darījums paredzēja nodrošinājuma kopfondu. Šis piemērs attiecas uz cenas palielinājumu vienam vērtspapīram, kas izmantots riska darījuma nodrošināšanai, tas ir, Vācijas valdības obligācijas cena palielinājās no 102 uz 103,3, bet nodrošinājuma ņēmējam bija vajadzīgas Vācijas valdības obligācijas, savukārt nodrošinājuma sniedzējs piekrita pieņemt Francijas valdības obligācijas. Abi darījumu partneri vienojās par šādu aizstāšanu — nodrošinājuma ņēmējs atgriež 2 000 000 EUR kā Francijas valdības obligāciju nodrošinājumu pēc nominālvērtības. Līdz ar to pārmērīgā 2 060 000 EUR Vācijas obligāciju nodrošinājuma tirgus vērtība tiek kompensēta ar 2 060 000 EUR pēc Francijas obligāciju nodrošinājuma tirgus vērtības, kas atrodas nodrošinājuma sniedzēja īpašumā (t. i., ar negatīvu zīmi no nodrošinājuma ņēmēja viedokļa), tādējādi atjaunojot sākotnējo neto nodrošinājuma līdzsvaru.
380. Jāatzīmē, ka lauki, ko piemēro vērtspapīriem nodrošinājuma datu atkārtojamajā iedaļā, tiek atkārtoti divreiz, lai paziņotu visu būtisko informāciju. Abi vērtspapīri ir pieejami turpmākai atkalizmantošanai.
381. Nodrošinājuma sniedzējam un nodrošinājuma ņēmējam jāsniedz informācija par nodrošinājumu, kā aprakstīts 95. tabulā, un jāiekļauj attiecīgās zīmes nodrošinājuma komponentiem, kas ir daļa no mainīgās drošības rezerves neto riska darījumiem, kā norādīts 373. punktā.

95. tabula. Neto riska darījums — SLB mainīgā drošības rezerve, kas nodrošināta ar nodrošinājuma kopfondu, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam			
No	Field	Example	XML Message
1. 3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;         ...       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;RptgCtrPty&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;           &lt;/RptgCtrPty&gt;           &lt;OthrCtrPty&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;           &lt;/OthrCtrPty&gt;         &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </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. tabula. Neto riska darījums — SLB mainīgā drošības rezerve, kas nodrošināta ar nodrošinājuma kopfondu, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

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> </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>
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>
87	Price per unit	103.015	<Id>

**95. tabula. Neto riska darījums — SLB mainīgā drošības rezerve, kas nodrošināta ar nodrošinājuma kopfondu, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

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

**95. tabula. Neto riska darījums — SLB mainīgā drošības rezerve, kas nodrošināta ar nodrošinājuma kopfondu, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/AsstTp&gt; &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;/Collsd&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.4 Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam

382. Piemērs, kas sniegts 96. tabulā, turpina piemēru 94. tabulā. Šajā gadījumā kā mainīgā drošības rezerve tiek atgriezts viens no vērtspapīriem, bet tas ir lielāks nekā sākotnējais daudzums, kas norādīts kā mainīgā drošības rezerve.

**96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;CtrPtyData&gt;             &lt;RptgCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;             &lt;/RptgCtrPty&gt;           &lt;OthrCtrPty&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMN&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;           &lt;/OthrCtrPty&gt;         &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;/CollUpd&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </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. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

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		<UnqTradIdr>UTI1</UnqTradIdr>
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>
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> <Id>

**96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
87	Price per unit	100	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI>
88	Collateral market value	50000000	> </ld>
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	DE	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Scty> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
98	Action type	COLU	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr>
3	Event date	24/04/2020	<Id>
9	Master agreement	GMRA	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> > </ld>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>

**96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

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

**96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

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

**96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement	GMRA	<Rpt> <CollUpd>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<CtrPtyData> <CtrPtyData>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<RptgCtrPty> <Id>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
84	Collateral unit of measure		<Id>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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	<UnqTradIdr>UTI3</UnqTradIdr> <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>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<Id>NL0010877000</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>



**96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
3	Event date	24/04/2020	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
9	Master agreement	GMRA	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
83	Collateral quantity or nominal amount	-2000000	<LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI>
84	Collateral unit of measure		</Id>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<JurstdctnCtry>NL</JurstdctnCtry> </Issr>
86	Price currency		<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	-2000000	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty>
89	Haircut or margin	0	</AsstTp>
90	Collateral quality	INVG	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	</RpTrad> </CollData>
92	Jurisdiction of the issuer	ES	... </CollUpd>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Rpt> <Rpt>
94	Collateral type	GOVS	<CollUpd> <CtrPtyData>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
98	Action type	COLU	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> </RptgCtrPty>

96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam

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



96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;AsstTp&gt;       &lt;Scty&gt;         &lt;Id&gt;ES0010877643&lt;/Id&gt;         &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTPR       &lt;/ClssfctnTp&gt;       &lt;QtyOrNmnlVal&gt;         &lt;NmnlVal&gt;           &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;101000000&lt;/Amt&gt;         &lt;/NmnlVal&gt;       &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;       &lt;UnitPric&gt;         &lt;Ptrg&gt;103.03&lt;/Ptrg&gt;       &lt;/UnitPric&gt;       &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;- 2000000&lt;/MktVal&gt;     &lt;/HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;     &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;     &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;     &lt;Issr&gt;       &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE &lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;JursdctnCtry&gt;ES&lt;/JursdctnCtry&gt;     &lt;/Issr&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;     &lt;/Tp&gt;     &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt; </pre>

**96. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpēja ieskaita kopā, paredzot līdzvērtīgu, bet ne to pašu vērtspapīru atgriešanu nodrošinājuma sniedzējam**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;     &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/CollData&gt;     ...     &lt;/CollUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.5 Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve ar skaidru naudu repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā (97. tabula)

383. Šis piemērs ir variants iepriekšējiem piemēriem par mainīgo drošības rezervi neto riska darījumos ar vērtspapīriem. Trīs VFD, kas identificēti ar UDI1, UDI2 un UDI3, darījuma līmenī ir nodrošināti ar vērtspapīriem, un pēc tam darījumu partneri ir vienojušies par skaidras naudas nodrošināšanu mainīgajai drošības rezervei. Nodrošinājuma sniedzējs dod papildu skaidru naudu riska darījuma segšanai.

**97. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve skaidras naudas repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;     &lt;Id&gt;   &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt;   &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt; </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	

**97. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve skaidras naudas repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

No	Field	Example	XML Message
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>UTI1</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>
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>
86	Price currency		<Id>
87	Price per unit	100	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> >

**97. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve skaidras naudas repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

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

**97. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve skaidras naudas repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

No	Field	Example	XML Message
84	Collateral unit of measure		<pre> &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; </pre>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
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 B	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	



**97. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve skaidras naudas repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

No	Field	Example	XML Message
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
84	Collateral unit of measure		</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Ptrg>100</Ptrg> </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>
90	Collateral quality	INVG	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Tp>
94	Collateral type	MEQU	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</Scty> </AsstTp>
98	Action type	GOVS	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</RpTrad> </CollData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	... </CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData>
3	Event date	24/04/2020	<RptgCtrPty>

**97. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve skaidras naudas repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaista kopā**

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement	GMRA	<Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
75	Type of the collateral component	CASH	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
76	Cash collateral amount	2000000	<Id>
77	Cash collateral currency	EUR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<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> <Qty>50000000</Qty> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <MntryVal> <Amt Ccy="EUR">10</Amt> </MntryVal> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>



**97. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve skaidras naudas repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Csh&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/Amt&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt;  &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.6 Mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama

384. 98. tabula papildina piemēru, kas iekļauts 97. tabulā, taču šajā gadījumā svarīgākais ir tas, ka dienas beigās nav apmainīts nekāds papildu nodrošinājums kā mainīgā drošības rezerve neto riska darījumu nodrošināšanai. Ziņošanas loģika ir līdzīga nulles nodrošinājuma paziņošanai, kā norādīts 5.4.4. punktā.

**98. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; </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	<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt; </pre>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	100000000	
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	

**98. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama**

No	Field	Example	XML Message
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>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Issr> <Id>
86	Price currency		<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</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>
90	Collateral quality	INVG	</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> <QtyOrNmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NmnlVal> <Amt
98	Action type	COLU	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal>

**98. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama**

No	Field	Example	XML Message
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	
9	Master agreement	GMRA	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
75	Type of the collateral component	SECU	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp>
83	Collateral quantity or V 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> <CtrPtyData>
88	Collateral market value	50000000	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty>
94	Collateral type	GOVS	<OthrPtyData> <AgtLndr>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>

**98. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama**

No	Field	Example	XML Message
98	Action type	COLU	</AgtLndr>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	</RpTrad>
3	Event date	24/04/2020	</LnData>
9	Master agreement	GMRA	<CollData> <RpTrad>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<AsstTp> <Scty>
75	Type of the collateral component	SECU	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</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	50000000	
89	Haircut or margin	0	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<Tp>



**98. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama**

No	Field	Example	XML Message
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	COLU	</RpTrad>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</CollData> ... </CollUpd>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
75	Type of the collateral component	CASH	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
76	Cash collateral amount	0	</Id> </OthrCtrPty>
77	Cash collateral currency	EUR	<OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>  <UnqTradldr>UTI3</UnqTradldr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt>



**98. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNORST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Csh&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/Amt&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/AsstTp&gt; &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; </pre>

**98. tabula. Neto riska darījums — mainīgā drošības rezerve repo darījumiem, kas sākotnēji nodrošināti darījuma līmenī un pēc tam iekļauti savstarpējā ieskaita kopā. Konkrētajā dienā pozīcija nemainās, un mainīgā drošības rezerve nav nepieciešama**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.8 Iepriekš apmaksāts nodrošinājums SLB darījumiem

385. Ziņojot par nepārprotamu nodrošinājuma piesaisti neto riska darījumiem, nodrošinājuma informācijas atjauninājumos jānorāda darījumu partneru LEI, jumta līgums, nodrošinājuma valutēšanas diena un konkrētais nodrošinājuma sadalījums, lai nodrošinājuma informācijas atjauninājumu varētu piesaistīt esošajiem VFD. Lauks “Nodrošinājuma valutēšanas diena” (2.74. lauks) ir piemērojams tikai saistībā ar SLB.

386. Notikuma datums precizē plānoto nodrošinājuma norēķinu datumu. Salīdzinot darījumu partneru LEI, jumta līgumu un sākotnējā darījuma ziņojuma datuma laukus, kas iekļauti nodrošinājuma informācijas atjauninājumā, ir iespējams noteikt, uz kuriem darījumiem attiecas nodrošinājuma informācijas atjauninājums par nenokārtoto neto summu. Piemērā, kas parādīts 99. tabulā, nodrošinājums jāpaziņo, pamatojoties uz paredzamo norēķinu, kas notiks 2020. gada 23. aprīlī un ir norādīts kā “Notikuma datums” (2.3. lauks). Laukā “Nodrošinājuma valutēšanas diena” (2.74. lauks) norāda datumu, no kura nodrošinājuma informācijas atjauninājumu piemēros nenokārtotiem aizdevumiem (t. i., nodrošinājums vairs nebūs “iepriekš apmaksāts”, sākot no 2020. gada 24. aprīļa). Tādējādi, lai noteiktu, uz kuriem VFD attiecas nodrošinājuma informācijas atjauninājums, nodrošinājuma valutēšanas diena jāsaista ar to VFD valutēšanas dienu un termiņa datumu, kuriem ir tādi paši darījumu partneru LEI un tas pats jumta līgums.

**99. tabula. Iepriekš apmaksāts nodrošinājums**

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-23	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;SctiesLndg&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-23&lt;/EvtDt&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;SctiesLndg&gt; &lt;Collsd&gt; </pre>
74	Value date of the collateral	2020-04-24	
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	
84	Collateral unit of measure		
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	

99. tabula. Iepriekš apmaksāts nodrošinājums			
No	Field	Example	XML Message
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> <Amt Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
90	Collateral quality	INVG	<UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">102000000</MktVal>
91	Maturity date of the security	2030-04-22	<HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI> </Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
94	Collateral type	GOVS	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
95	Availability for collateral reuse	true	</Scty> </AsstTp> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData> ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

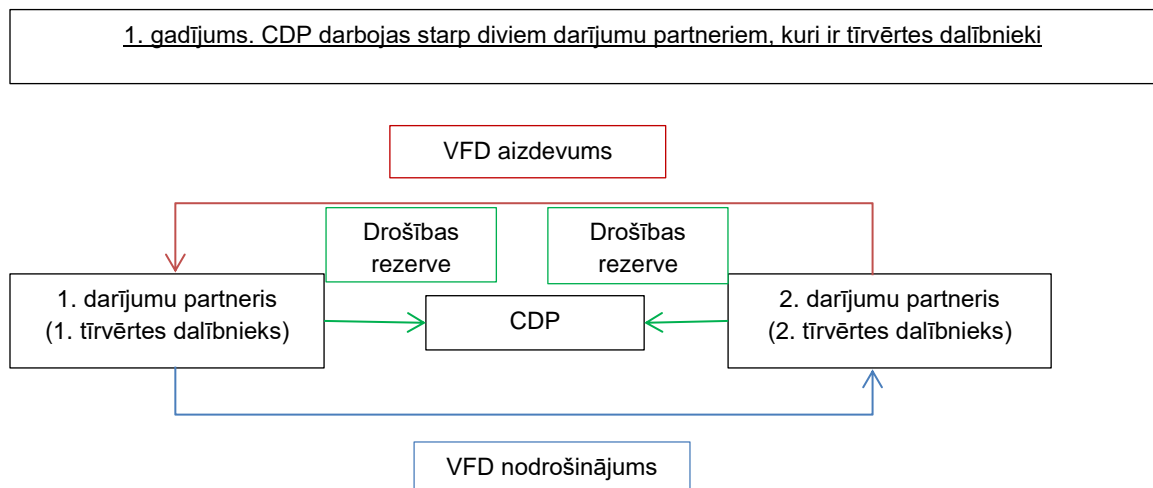
## 5.4.9 Tīrvērtētu darījumu portfelis

387. Paziņojot 2.97. lauku ("Portfeļa kods"), darījumu partneriem jāpārliedz, ka viņi savos ziņojumos šo kodu izmanto konsekventi. Ja kods identificē portfeli, kurā ir nodrošināti darījumi, kas ietver arī atvasinātos instrumentus, darījumu partneriem jāizmanto tas pats kods, ko izmanto, ziņojot saskaņā ar ETIR.
388. Arī portfeļa koda lielumam nav jābūt vispārēji unikālam, taču tas ir jāizmanto konsekventi. Tā kā 2.97. lauks satur neatbilstīgu lielumu, abiem darījumu partneriem, slēdzot darījumu, nav jāvienojas par šo lielumu.

## 5.5 Dati par drošības rezervi

389. Šajā iedaļā iekļautie dati jāpaziņo visiem darījumu partneriem, kuru VFD ir veikta centralizēta tīrvērtē, ja vien uz šiem darījumu partneriem neattiecas obligātā deleģēšana saskaņā ar 4. panta 2. punktu, un tādā gadījumā ziņojošajai struktūrai jābūt tai, kas norādīta minētajā pantā.
390. Lai varētu izmantot CDP pakalpojumus, gan 1. tīrvērtes dalībniekam, gan 2. tīrvērtes dalībniekam jānosūta CDP ziņas par drošības rezervi. Šī drošības rezerve sastāv no sākotnējās drošības rezerves un mainīgās drošības rezerves<sup>16</sup>. Drošības rezervei, par kuru tīrvērtes dalībnieki informē CDP, nav tiešas saistības ar VFD nodrošinājumu. CDP izmanto šo drošības rezervi, lai segtu visus riskus, kas izriet no darījumiem, kuriem tas veic tīrvērti attiecīgo tīrvērtes dalībnieku labā. Drošības rezerve, par kuru tīrvērtes dalībnieki informē CDP, var segt arī riskus, kas izriet no darījumiem, kuri nav VFD, piemēram, no darījumiem ar atvasinātiem instrumentiem.

### 5.5.1 CDP darbojas starp diviem darījumu partneriem, kuri ir tīrvērtes dalībnieki

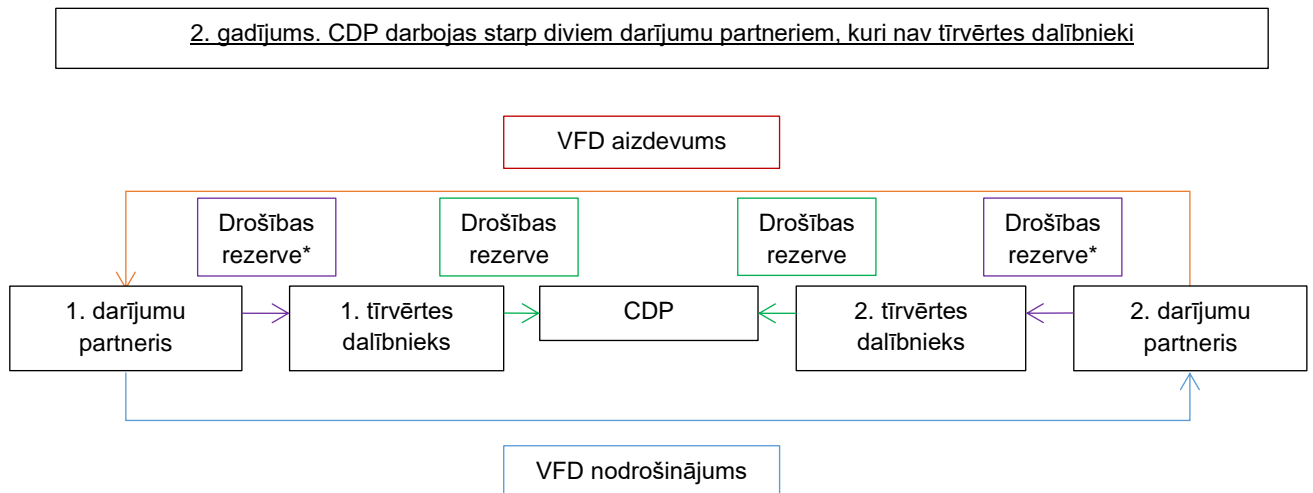


<sup>16</sup> Var izveidoties arī drošības rezerves pārsniegums kā tāda nodrošinājuma daļa, kas pārsniedz nepieciešamo līmeni.

391. Ja darījumu partneris pats nav tīrvērtes dalībnieks, drošības rezerve, kuru viņš nodrošina tīrvērtes dalībniekam (sk. turpmāk “Drošības rezerve\*” 2. gadījumā), var atšķirties no drošības rezerves, kuru tīrvērtes dalībnieks norādījis CDP.

### 5.5.2 CDP darbojas starp diviem darījumu partneriem, kuri nav tīrvērtes dalībnieki

•



### 5.5.3 Informācijas par drošības rezervi paziņošana

392. Gadījumā, ja pastāv trešais veids, kā apmainīties ar informāciju par drošības rezervi, darījumu partneriem jāvienojas un konsekventi tā jāpaziņo vai nu kā sākotnējā drošības rezerve, vai kā mainīgā drošības rezerve.

393. Sākotnējā drošības rezerve, mainīgā drošības rezerve un nodrošinājuma pārsniegums katrs tiek paziņots ar vienu skaitli, kas sastāv no visu saņemto/ nosūtīto/ iekļāto aktīvu kategoriju bruto (pirmsdiskonta) lielumiem. Gadījumā, ja tīrvērtētajā portfeli nav atvasinātu instrumentu, ieteicams izmantot CDP pamatvalūtu, tomēr, ja tajā ir atvasināti instrumenti, kas paziņojami saskaņā ar ETIR, jāizmanto tā pati valūta.

394. Informācija par drošības rezervi attiecas tikai uz CDP tīrvērtētiem VFD. Gadījumā, kas minēts 100. tabulā, struktūra nodrošināšanai izmanto to pašu portfeli, ko saskaņā ar ETIR. Ziņojošais darījumu partneris J, kas vienlaikus ir arī tīrvērtes dalībnieks, izmanto deleģētos ziņošanas pakalpojumus, ko nodrošina darījumu partneris D. Tas ziņo par summu 1 000 000 EUR apmērā kā par sākotnējo drošības rezervi un par 300 000 EUR kā mainīgo drošības rezervi, kas piesaistīta CDP O. Darījumu partneris arī ziņo par nodrošinājuma pārsniegumu 100 000 EUR apmērā.

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



## 5.6 Atkalizmantošanas dati, naudas atkalieguldīšana un finansējuma avoti

395. Kā uzsvērts RTS, loģika, kas ir TS par ziņošanu pielikuma 4. tabulas pamatā, atšķiras no citām tabulām, un to neizmanto saskaņošanai, jo šo informāciju nevar saistīt ar atsevišķiem darījumiem. Tā vietā bezskaidras naudas nodrošinājuma atkalizmantošana, naudas nodrošinājuma atkalieguldīšana un finansēšanas avoti jāpaziņo kā kopsavilkums ziņojošās struktūras līmenī.
396. Turklāt, ja dati par nodrošinājuma atkalizmantošanu, naudas atkalieguldīšanu vai finansējuma avotiem tiek paziņoti dažādos laika posmos, tikai pirmais ziņojums jāpaziņo ar darbības veidu “NEWT” attiecībā uz ziņojošā darījumu partnera un par ziņošanu atbildīgās struktūras konkrēto kombināciju neatkarīgi no laukiem, kas ziņojumā iekļauti. Nākamie ziņojumi attiecībā uz šo kombināciju jāsigatavo ar atbilstošu darbības veidu.

### 5.6.1 Nodrošinājuma atkalizmantošana

397. Nodrošinājuma atkalizmantošana jāpaziņo, izmantojot formulu, kas saskaņota FSP ietvarā<sup>17</sup> un iekļauta RTS. Tirgus dalībnieki parasti nenošķir savus aktīvus no nodrošinājuma, ko saņēmuši no darījumu partneriem (ar nosacījumu, ka nodrošinājuma vērtspapīri ir derīgi atkalizmantošanai). Tādēļ FSP formulas pamatideja ir tāda, ka struktūrām jāiesniedz atkalizmantotā nodrošinājuma summas novērtējums, pamatojoties uz saņemtā nodrošinājuma daļu, salīdzinājumā ar pašu aktīviem.
398. Ziņošanas pienākums attiecas tikai uz VFD, un tas nozīmē, ka nodrošinājuma vērtspapīri, kas izvietoti vai saņemti no citiem darījumiem, nav piemērojami. Citiem vārdiem, formulā nav jāiekļauj nodrošinājums, kas norādīts maržināliem darījumiem ar atvasinātajiem instrumentiem vai jebkuriem citiem darījumiem, kuri neietilpst VFDR darbības jomā, kā aprakstīts 4.2.1. punktā.
399. Tas arī nozīmē, ka par atkalizmantošanas formulas komponentiem nav atsevišķi jāziņo ESMA. Tā vietā ziņojošajām struktūrām jāiesniedz tikai novērtējums, kas izriet no formulas piemērošanas ISIN līmenī.
400. Ja faktiskā atkalizmantošana nenotiek, šis ziņojuma lauks jāatstāj tukšs. Ja nodrošinājumu vairs neizmanto atkārtoti, tas jāpaziņo kā “atkalizmantošanas atjauninājums” (REUU) ar “0”.
401. Ja ziņošana tiek deleģēta, darījumu partneris, kuram ir deleģēta ziņošana, nav atbildīgs par plānotās nodrošinājuma atkalizmantošanas paziņošanu. NFC paši ir atbildīgi par plānotās atkalizmantošanas aprēķināšanu un laikus iesniedz tāmi darījumu partnerim, kas atbild par ziņošanu.
402. Ja darījumu partneri labāk izvēlas ziņot par faktisko atkalizmantošanu, nevis par plānoto atkalizmantošanu, viņi var tā darīt.

---

<sup>17</sup> FSP bezskaidras naudas nodrošinājuma atkalizmantošana — mērīšana un metrika: <http://www.fsb.org/wp-content/uploads/Non-cash-Collateral-Re-Use-Measures-and-Metrics.pdf>.

403. FSP ietvarā terminu “nodrošinājums” vispārīgi definē pēc ekonomiskās funkcijas, t. i., tas jāizprot kā vērtspapīri, neatkarīgi no darījuma juridiskās struktūras. Attiecībā uz piemērošanas jomu *saņemts un atkalizmantošanai piemērots nodrošinājums* ir:
- vērtspapīri, kas saņemti kā nodrošinājums reversos repo darījumos un BSB;
  - vērtspapīri, kas aizņemti vērtspapīru aizņēmuma darījumos;
  - vērtspapīri, kas saņemti kā nodrošinājums vērtspapīru aizdevuma darījumos;
  - vērtspapīri, kas saņemti kā papildu nodrošinājums, lai izpildītu mainīgās drošības rezerves prasības, kas izriet no VFD.
404. Ieķīlātās sākotnējās drošības rezerves, kas ir izolētas un imobilizētas (piemēram, saistībā ar atvasinātajiem instrumentiem) un kas tādēļ nav piemērotas atkalizmantošanai, nav jāiekļauj novērtējumā.
405. Drošības rezerves aizdevumos nodrošinājuma piemērotība atkalizmantošanai ir atkarīga ne tikai no darījumā izmantotā nodrošinājuma veida, bet arī no līgumā noteiktajiem ierobežojumiem (“rehipotekācijas limita”), par kuriem vienojas specializētais māklers (brokeris) un viņa klients. Šo ierobežojumu aprēķina kā fiksētu īpatsvaru procentos no drošības rezerves aizdevuma nenokārtotās dienas summas. Lai nodrošinājumu varētu atkalizmantot, vērtspapīri, kuriem ir tiesības uz rehipotekāciju, vispirms ir jāpārskaita no klienta konta uz specializētā māklera (brokera) paša kontu, nepārsniedzot ierobežojumu. ESMA ierosina, lai, aprēķinot atkalizmantošanas formulu, no *saņemtā nodrošinājuma, kas ir piemērots atkalizmantošanai*, tiktu izslēgti nodrošinājuma vērtspapīri, kurus nevar pārskaitīt uz specializētā māklera (brokera) paša kontu, ņemot vērā līgumā noteikto rehipotekācijas ierobežojumu. Deponētos, bet nepiesaistītos vērtspapīrus nevajadzētu iekļaut. Šādu vērtspapīru iekļaušana liktu pārāk augstu novērtēt faktiski atkalizmantotā nodrošinājuma summu.
406. Līdzīgi, izvietotais nodrošinājums ietver:
- vērtspapīrus, kas izvietoti kā nodrošinājums repo darījumos un SBB;
  - aizdotos vērtspapīrus;
  - vērtspapīrus, kas izvietoti kā nodrošinājums vērtspapīru aizņēmuma darījumos;
  - vērtspapīrus, kas izvietoti kā nodrošinājums, lai izpildītu mainīgās drošības rezerves prasības, kas izriet no VFD.
407. No atkalizmantošanas formulas jāizslēdz visi vērtspapīri, kas saņemti vai izvietoti tādu darījumu ietvaros, kuri neietilpst VFDR darbības jomā, tostarp VFD, kas tiek izpildīti ar ECBS darījumu partneriem.

408. CDP no atkalizmantošanas novērtējuma jāizslēdz nodrošinājuma vērtspapīri, kas tiek pārskaitīti starp tīrvērtes dalībniekiem viņu centralizētās tīrvērtes darbības ietvaros. Tas attiecas gan uz formulas komponentu "Saņemtais nodrošinājums", gan uz "Atkalizmantotais nodrošinājums". CDP pats šiem nodrošinājuma vērtspapīriem neveic atkalizmantošanu, jo vērtspapīru pārskaitījums drīzāk atspoguļo novācības procesu, kas notiek tad, kad centrālais darījumu partneris sāk darboties starp abiem sākotnējiem darījumu partneriem. Nodrošinājuma vērtspapīri, kas saņemti kā drošības rezerve, attiecīgā gadījumā jāiekļauj novērtējumā, un paredzams, ka CDP ziņos par jebkuru atkalizmantošanu, kas notiks citu darbību ietvaros. Tas ietver kases operācijas un jebkura cita veida līnijas vai mehānismus (piemēram, reversos vērtspapīru aizdevumus), kas varētu būt CDP rīcībā.
409. Attiecībā uz FSP ietvarā iekļauto nodrošinājuma atkalizmantošanas metriku<sup>18</sup>, to tiešā veidā aprēķinās valsts vai starptautiskās iestādes, pamatojoties uz nodrošinājuma atkalizmantošanu, par kuru ziņojušas struktūras. Lai noteiktu atkalizmantošanas rādītāju, iestādēm jāaprēķina saucējs, pamatojoties uz struktūru paziņotajiem 2. tabulas datiem.

#### 5.6.1.1 Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, bez ziņošanas deleģēšanas

410. 101. tabula parāda gadījumu, kurā darījumu partneris B paziņo atkalizmantoto vērtspapīru vērtību ar ISIN IT00BH4HKS39 par summu 10 000 000 EUR.

101. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, bez ziņošanas deleģēšanas			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <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>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	SECU	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty>
7	Collateral component	{ISIN}	<NttyRspnsblForRpt>
8	Value of reused collateral		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
9	Estimated reuse of collateral	10000000	</CtrPtyData> <CollCmpnt>

<sup>18</sup> Skatīt FSP ietvara 4. iedaļu par bezskaidras naudas nodrošinājuma atkalizmantošanu.

**101. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, bez ziņošanas deleģēšanas**

No	Field	Example	XML Message
10	Reused collateral currency	EUR	<pre> &lt;Scty&gt;   &lt;ISIN&gt;IT00BH4HKS39&lt;/ISIN&gt;   &lt;ReuseVal&gt;     &lt;Estmtd       Ccy="EUR"&gt;10000000&lt;/Estmtd&gt;     &lt;/ReuseVal&gt;   &lt;/Scty&gt; &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-23&lt;/EvtDt&gt; ... &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt;  &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>
18	Action type	REUU	

5.6.1.2 Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, ar ziņošanas deleģēšanu

411. 102. tabula parāda gadījumu, kurā darījumu partneris A deleģē ziņošanu darījumu partnerim B. Tas paziņo atkalizmantoto vērtspapīru vērtību ar ISIN IT00BH4HKS39 par summu 10 000 000 EUR.

**102. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, ar ziņošanas deleģēšanu**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollReuseUpd&gt;       ...       &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;RptSubmitgNtty&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptSubmitgNtty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; </pre>
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	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		

**102. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, ar ziņošanas deleģēšanu**

No	Field	Example	XML Message
9	Estimated reuse of collateral	10000000	<pre> &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; &lt;Scty&gt; &lt;ISIN&gt; IT00BH4HKS39&lt;/ISIN&gt; &lt;ReuseVal&gt; &lt;Estmtd Ccy="EUR"&gt;10000000&lt;/Estmtd&gt; &lt;/ReuseVal&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-23&lt;/EvtDt&gt; ... &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

5.6.1.3 Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vienu darījumu partneri

412. 103. tabula parāda gadījumu, kurā darījumu partneris C ir NFC, kas ir MVU, un ir noslēdzis VFD ar tikai ar vienu struktūru — darījumu partneri B (FC). Darījumu partneris B paziņo atkalizmantoto vērtspapīru vērtību ar ISIN IT00BH4HKS39 par summu 10 000 000 EUR.

**103. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vienu darījumu partneri**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollReuseUpd&gt; ... &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHIJK&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt; </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}	

103. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vienu darījumu partneri			
No	Field	Example	XML Message
8	Value of reused collateral		<LEI> ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
9	Estimated reuse of collateral	10000000	</NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData>
10	Reused collateral currency	EUR	<CollCmpnt> <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>

#### 5.6.1.4 Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem

413. 104. un 105. tabula satur informāciju, kas jāpaziņo par NFC, kas ir MVU, veiktu atkalizmantošanu ar vairākiem darījumu partneriem. Šajā piemērā ir divas tabulas. Tomēr tabulas var būt tikpat daudz kā darījumu partneru, ar kuriem NFC, kas ir MVU, ir noslēdzis VFD un pēc tam ir atkalizmantojis nodrošinājumu.
414. Šajā gadījumā darījumu partneris C ir NFC, kas ir MVU, un ir noslēdzis VFD ar divām struktūrām — darījumu partneri B un darījumu partneri D. Darījumu partneris B paziņo atkalizmantoto vērtspapīru vērtību ar ISIN IT00BH4HKS39 par summu 10 000 000 EUR, kā parādīts 104. tabulā. Darījumu partneris D paziņo atkalizmantoto vērtspapīru vērtību ar ISIN FR00BH4HKS3 par summu 2 000 000 EUR, kā parādīts 105. tabulā.

104. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (1)			
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>

**104. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (1)**

No	Field	Example	XML Message
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	SECU	<LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</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> <Estmtd
18	Action type	REUU	Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData>  </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

**105. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (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>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>



**105. tabula. Vērtspapīru atkalizmantošana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (2)**

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

### 5.6.2 Naudas nodrošinājuma atkalieguldīšana

415. Darījumu partneriem jāziņo par naudas nodrošinājuma atkalieguldīšanu, ja skaidra nauda tiek izmantota kā nodrošinājums SLB darījumos un to atkaliegulda vai nu tieši aizdevējs (nodrošinājuma ņēmējs), vai aizdevēja vārdā to dara viņa pārstāvis. Ziņošana par atkalieguldījumu nav atkarīga no iesaistītā finanšu darījumu partnera veida, piemēram, vai tas ir brokeris, dīleris, ieguldījumu uzņēmums vai cits. Tā ir saistīta ar viņa funkciju attiecīgajos VFD.
416. Atkalieguldīšanas veids (4.12. lauks) un atkalieguldītās naudas summa (4.13. lauks) jāsadala pēc atkalieguldītā naudas nodrošinājuma valūtas (4.14. lauks). Tā kā ir paredzams, ka darījumu partneri paziņos vienotu atkalieguldīšanas likmi bez sadalījuma pa valūtām, atkalieguldīšanas likme (4.11. lauks) jāaprēķina kā vidējā svērtā likme, kuras pamatā ir atkalieguldītā naudas summa (4.13. lauks) pēc konvertēšanas atkalieguldītās naudas valūtā (4.14. lauks).
417. Tas attiecas arī uz skaidro naudu, kas saņemta, lai izveidotu drošības rezervi VFD, kuri nav centralizēti tīrvērtēti, un pēc tam tiek atkalieguldīta.



418. Skaidra nauda, kas saņemta no maržināla aizdevuma un pēc tam atkalieguldīta, nav jāpaziņo kā naudas nodrošinājuma atkalieguldījums. Informāciju par naudas nodrošinājuma paziņošanu saistībā ar maržināliem aizdevumiem skatīt 5.3.16. punktā.
419. Gadījumā, ja ziņojošais darījumu partneris nevar nodalīt savu skaidro naudu no naudas, kas saņemta kā naudas nodrošinājums, naudas atkalieguldījuma summa jāaprēķina, izmantojot to pašu metodiku kā bezskaidras naudas nodrošinājumam.
420. CDP saņemtais naudas nodrošinājums (saistībā ar prasībām par drošības rezervi) un naudas nodrošinājuma atkalieguldījumi jau ir publiskoti CPMI-IOSCO Kvantitatīvās informācijas publiskas atklāšanas standartos<sup>19</sup>. Lai gan ziņošana saskaņā ar VFDR notiek katru dienu (nevis reizi ceturksnī, kā tas ir Kvantitatīvās informācijas publiskas atklāšanas standartu gadījumā), salīdzināmā detalizācijas pakāpe un apkopotās informācijas veids nenodrošina papildu ziņojumus. Tādēļ CDP naudas nodrošinājuma atkalieguldījumi nav iekļauti.
421. Visbeidzot, attiecībā uz ziņošanu par naudas nodrošinājuma atkalieguldījumiem darījumu partneriem jāņem vērā arī visi turpmākie norādījumi vai paskaidrojumi, ko šajā jomā sniedz FSP.

#### 5.6.2.1 Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, bez ziņošanas deleģēšanas

422. 106. tabula parāda gadījumu, kurā darījumu partneris B ziņo par saviem skaidras naudas atkalieguldījumiem 100 000 EUR apmērā ar 1,5 % likmi repo darījumu tirgū.

106. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, bez ziņošanas deleģēšanas			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
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	
11	Reinvestment Rate	1.5	

<sup>19</sup> CPMI-IOSCO, 2015. gada februāris, "Kvantitatīvās informācijas publiskas atklāšanas standarti centrālajiem darījumu partneriem": <https://www.bis.org/cpmi/publ/d125.pdf>.

106. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, bez ziņošanas deleģēšanas			
No	Field	Example	XML Message
12	Type of re-invested cash investment	REPM	</RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
14	Re-invested cash currency	EUR	</NttyRspnsblForRpt> </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 Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, ar ziņošanas deleģēšanu

423. 107. tabula parāda gadījumu, kurā darījumu partneris A deleģē ziņošanu par skaidras naudas atkalieguldīšanu darījumu partnerim B. Darījumu partneris B ziņo par skaidras naudas atkalieguldīšanu 100 000 EUR apmērā ar 1 % likmi repo darījumu tirgū.

107. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, ar ziņošanas deleģēšanu			
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>

**107. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic FC vai NFC, kas nav MVU, ar ziņošanas deleģēšanu**

No	Field	Example	XML Message
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>12345678901234500000</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</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

### 5.6.2.3 Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vienu darījumu partneri

424. 108. tabula parāda gadījumu, kurā darījumu partneris C ir NFC, kas ir MVU un ir noslēdzis VFD ar tikai vienu struktūru — darījumu partneri B. Darījumu partneris B ziņo par skaidras naudas nodrošinājuma atkalieguldīšanu 100 000 EUR apmērā ar 1 % likmi repo darījumu tirgū.

**108. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vienu darījumu partneri**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <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 C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>123456789ABCDEFGHJKLM</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</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</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData>  </SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

#### 5.6.2.4 Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem

425. 109. un 110. tabula satur informāciju, kas jāpaziņo par NFC, kas ir MVU, veiktu nodrošinājuma atkalieguldīšanu ar vairākiem darījumu partneriem. Šajā piemērā ir divas tabulas. Tomēr tabulas var būt tikpat daudz kā darījumu partneru, ar kuriem NFC, kas ir MVU, ir noslēdzis VFD un pēc tam ir atkalieguldījis naudas nodrošinājumu.
426. Šajā gadījumā darījumu partneris C ir NFC, kas ir MVU, un ir noslēdzis VFD ar divām struktūrām — darījumu partneri B un darījumu partneri D. Darījumu partneris B paziņo atkalieguldītā naudas nodrošinājuma summu 100 000 EUR apmērā, kā parādīts 109. tabulā. Darījuma partneris D paziņo atkalieguldītā naudas nodrošinājuma summu 100 000 EUR apmērā, kā parādīts 110. tabulā.

109. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (1)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollReuseUpd&gt;       ...     &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;RptSubmitgNtty&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptSubmitgNtty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHJKLM&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;CollCmpnt&gt;           &lt;Csh&gt;             &lt;RinvstdCsh&gt;               &lt;Tp&gt;REPM&lt;/Tp&gt;               &lt;RinvstdCshAmt                 Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/RinvstdCshAmt&gt;               &lt;/RinvstdCsh&gt;             &lt;/Csh&gt;             &lt;CshRinvstmtRate&gt;1&lt;/CshRinvstmtRate&gt;           &lt;/Csh&gt;         &lt;/CollCmpnt&gt;       &lt;EvtDt&gt;           </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. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (1)**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> 2020-04-23 &lt;/EvtDt&gt; ... &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>

**110. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (2)**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollReuseUpd&gt; ... &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHIJK&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; &lt;Csh&gt; &lt;RinvstdCsh&gt; &lt;Tp&gt;REPM&lt;/Tp&gt; &lt;RinvstdCshAmt Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/RinvstdCshAmt&gt; &lt;/RinvstdCsh&gt; &lt;CshRinvstmtRate&gt;1&lt;/CshRinvstmtRate&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt; </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. tabula. Skaidras naudas atkalieguldīšana, ko veic NFC, kas ir MVU, ar vairākiem darījumu partneriem (2)**

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

**5.6.3 Nulles līmeņa bezskaidras naudas nodrošinājuma atkalizmantošana un skaidras naudas atkalieguldīšana**

427. 111. tabula ilustrē, kā paziņojami lauki, ja nenotiek ne bezskaidras naudas nodrošinājuma atkalizmantošana, ne skaidras naudas nodrošinājuma atkalieguldīšana. Tādējādi darījumu partneriem jāziņo tā, kā norādīts 111. tabulā.

428. Šajā gadījumā RTS 4. tabulas 12. lauks "Naudas atkalieguldīšanas veids" jāaizpilda kā "Cits".

**111. tabula. Nulles līmeņa naudas nodrošinājuma atkalizmantošana**

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

**111. tabula. Nulles līmeņa naudas nodrošinājuma atkalizmantošana**

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

#### 5.6.4 Finansējuma avoti

429. Lauki, kas attiecas uz finansējuma avotiem, jāpaziņo tikai gadījumos, kad ir maržināls aizdevums vai nenokārtota īstermiņa tirgus vērtība. Ziņojošajiem darījumu partneriem vai struktūrām, kas ir atbildīgas par ziņošanu, šī informācija jāiesniedz ziņojošā darījumu partnera līmenī, nevis atsevišķa darījuma līmenī.
430. 112. tabula parāda gadījumu, kurā darījumu partneris B ziņo par summu 5 000 000 EUR apmērā kā par finansējuma avotu no repo darījumu tirgus, lai finansētu maržinālos aizdevumus.

**112. tabula. Finansējuma avoti**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;Crrctn&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; </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	
15	Funding sources	REPO	



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

## 6 Atgriezeniskā saite noraidījuma gadījumā

431. RTS par datu vākšanu 1. panta 1. punkts paredz dažādas pārbaudes, kas darījumu reģistram jāveic, lai nodrošinātu saskaņā ar VFDR 4. pantu paziņoto VFD datu pareizību un pilnīgumu.
432. Darījumu reģistram jānodrošina atgriezeniskā saite noraidījuma gadījumā saskaņā ar šādām noraidījumu kategorijām:
- iesnieguma shēmas apstiprinājums saskaņā ar RTS par datu vākšanu 1. panta 1. punkta b) apakšpunktu;
  - ziņojuma iesniedzējas struktūras pilnvarojums/atļauja saskaņā ar RTS par datu vākšanu 1. panta 1. punkta c) apakšpunktu;
  - iesnieguma loģiskais apstiprinājums saskaņā ar RTS par datu vākšanu 1. panta 1. punkta d)–j) apakšpunktu;
  - uzņēmējdarbības noteikumi vai iesnieguma satura apstiprinājums saskaņā ar RTS par datu vākšanu 1. panta 1. punkta k) apakšpunktu, iekļaušana apstiprināšanas noteikumos un atbilstība šīm pamatnostādņēm.
433. Jāatzīmē, ka struktūras autentifikāciju darījumu reģistrs veiks, kamēr darbosies savienojums ar darījumu reģistra sistēmu; tādējādi netiks veidota nekāda īpaša atgriezeniskā saite noraidījumu gadījumos.

434. Darījumu reģistram jāpārbauda faila atbilstība XML shēmai (visa faila un konkrēto VFD ziņojumu sintakse). Ja fails nebūs atbilstīgs, viss fails (visi failā iekļautie darījumi) tiks noraidīts, un iemesls būs tāds, ka fails ir “bojāts”.
435. Tā kā RTS par datu vākšanu 1. panta 1. punkta c) apakšpunktā ir noteikts, ka šai pārbaudei jānotiek, pārbaudot darījumu reģistram iesniegtos ziņojumus, un, lai gan atļaušanas attiecības var iedibināt, pieslēdzoties sistēmai, ziņošanas atļauja jāpārbauda arī iesniegšanas līmenī, un darījumu reģistram jānoraida visi iesniegumi, kuri neiztur šo pārbaudi, nosūtot atbilstošu atgriezeniskās saites ziņojumu.
436. Darījumu reģistram jāizmanto attiecīgs ISO 20022 XML ziņojums, lai nodrošinātu atgriezenisko saiti par apstiprināšanu tām struktūrām, kas pieslēdzas attiecīgajam darījumu reģistram. Sūtot darījumu partneriem noraidījumus, darījumu reģistram jāizmanto ziņojuma laukos iekļautie kodi.
437. Pēc noraidījuma saņemšanas ziņojošajiem darījumu partneriem vai struktūrām, kas atbild par ziņošanu, tiešā veidā vai ar ziņojuma iesniedzējstruktūras starpniecību jāiesniedz pareizi un pilnīgi ziņojumi, ievērojot paziņošanas termiņu, kas noteikts VFDR 4. panta 1. punktā.
438. Ja fails satur trīs darījumus, bet tie neiztur apstiprināšanu, statistika uzrāda šo failu kā pieņemtu, bet ar trim noraidītiem darījumiem.
439. Ja datu failā, kuru iesniedzis ziņojošais darījumu partneris, par ziņošanu atbildīgā struktūra vai ziņojuma iesniedzēja struktūra, konstatē nopietnu shēmas kļūdu un darījumus nevar apstiprināt, par to ziņo kā par viena faila noraidījumu.
440. Papildus iepriekš minētajai informācijai darījumu reģistrs katram ziņojošajam darījumu partnerim, par ziņošanu atbildīgajai struktūrai vai ziņojuma iesniedzējai struktūrai attiecīgā gadījumā iesniedz dienas beigu ziņojumu (auth. 084.001.01), kurā ir šāda informācija.

113. tabula. Atgriezeniskā saite noraidījuma gadījumā

No.	Field	Details to be reported	XML Message
1	Number of files received	Numeric values	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxStsAdv&gt;   &lt;TxRptStsAndRsn&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;RptSttstcs&gt;         &lt;TtlNbOfRpts&gt;2&lt;/TtlNbOfRpts&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TxRptStsAndRsn&gt;   &lt;TtlNbOfRptsAccptd&gt;1&lt;/TtlNbOfRptsAccptd&gt;   &lt;TtlNbOfRptsRjctd&gt;1&lt;/TtlNbOfRptsRjctd&gt;   &lt;NbOfRptsRjctdPerErr&gt;     &lt;DtldNb&gt;1&lt;/DtldNb&gt;   &lt;RptSts&gt;     &lt;MsgRptld&gt;ReportID&lt;/MsgRptld&gt;     &lt;Sts&gt;RJCT&lt;/Sts&gt;     &lt;DtldVldtnRule&gt;       &lt;ld&gt;RuleID&lt;/ld&gt;     &lt;Desc&gt;Rule description&lt;/Desc&gt;     &lt;SchmeNm&gt; </pre>
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	
10	Identification of the SFT		
11	Reporting counterparty	Table A Field 3	
12	UTI	Table B Field 1	
13	Other counterparty	Table A Field 11	
14	Master agreement type	Table B Field 9	
15	Rejection reason	Error codes	

16	Rejection description	Error description	<pre> &lt;Cd&gt;1&lt;/Cd&gt; &lt;/SchmeNm&gt; &lt;/DtldVldtnRule&gt; &lt;/RptSts&gt; &lt;/NbOfRptsRjctdPerErr&gt; &lt;/RptSttstcs&gt; &lt;TxSttstcs&gt; &lt;TtlNbOfTxs&gt;2&lt;/TtlNbOfTxs&gt;  &lt;TtlNbOfTxsAccptd&gt;1&lt;/TtlNbOfTxsAccptd&gt;  &lt;TtlNbOfTxsRjctd&gt;1&lt;/TtlNbOfTxsRjctd&gt; &lt;NbOfTxsRjctd&gt; &lt;TxId&gt; &lt;Tx&gt; &lt;RptgCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;Vrsn&gt;2019&lt;/Vrsn&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;/TxId&gt; &lt;Sts&gt;RJCT&lt;/Sts&gt; &lt;DtldVldtnRule&gt; &lt;Id&gt;RuleID&lt;/Id&gt; &lt;Desc&gt;Rule description&lt;/Desc&gt; &lt;/DtldVldtnRule&gt; &lt;/NbOfTxsRjctd&gt; &lt;/TxSttstcs&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TxRptStsAndRsn&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxStsAdv&lt; </pre>
----	-----------------------	-------------------	---

441. Tas nodrošina, ka gadījumos, kad ziņojošais darījumu partneris vai par ziņošanu atbildīgā struktūra tiešā veidā neziņo darījumu reģistram, bet izmanto tikai apskatāmu (view-only) kontu, viņiem jābūt iespējai iegūt detalizētu izpratni par to, kā viņi izpilda VFDR noteiktos ziņošanas pienākumus.

## 7 Atgriezeniskā saite saskaņošanas gadījumā

442. Aizdevumu pāru saskaņošanas procesā starp darījumu reģistriem tie i) saskaņo aizdevumus aizdevumu saskaņošanas laukos un vienlaikus ii) saskaņo nodrošinājumu nodrošinājuma saskaņošanas laukos. Tādējādi nodrošinājums netiks sapārots neatkarīgi no tā, vai tas ir darījuma nodrošinājums, vai neto riska darījuma nodrošinājums. Jāsapāro ir tikai aizdevumi, un tiks savietoti tie nodrošinājumi, kas saistīti ar aizdevumiem ar darījuma līmeņa nodrošinājumu vai neto riska darījuma nodrošinājumu. Darījumu reģistri nedrīkst sapārot nodrošinājumus, un gadījumā, ja viena puse nenodrošina neto riska darījumu ar nodrošinājumu, par katru nodrošinājuma aktīvu jāziņo saskaņošanas rezultātu statusa ziņojuma iedaļā “Neatbilst”, un nodrošinājuma saskaņošanas statuss būs “Nav saskaņots”.

114. tabula. Saskaņošanas kategorijas	
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. Pēc tam, kad ir saņemts, pieņemts un pārbaudīts ziņojums ar darbības veidu “KĻŪDA”, darījumu reģistram nekavējoties jāizslēdz konkrētais VFD no saskaņošanas, t. i., no tūlīt sekojošā saskaņošanas cikla.
444. Turklāt nevienam VFD nevar “atdzīvīnāt”, tādēļ VFD jāizslēdz no saskaņošanas 30 dienas pēc termiņa beigām vai pēc tā pirmstermiņa izbeigšanas, t. i., ziņojot ar darbības veidu “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana” vai “Pozīcijas komponents” saskaņā ar nosacījumiem, kas paredzēti RTS par pārbaudi 2. panta 2. punkta h) apakšpunktā. Arī, ja tiek saskaņota informācija par nodrošinājumu, šie ziņojumi atšķiras no ziņojumiem par aizdevumu ar to, ka tajos nenorāda termiņus. Attiecībā uz neto riska darījumu nodrošinājumu tas nozīmē, ka datums tiek saistīts ar VFD aizdevuma puses datumu. Tādējādi darījumu reģistram jācenšas saskaņot šo informāciju trīsdesmit dienu laikā pēc pēdējā aizdevuma, kas ir iekļauts neto riska darījuma nodrošināšanā, izbeigšanas vai termiņa beigām. Turklāt nodrošinājuma saskaņošanas statuss neto riska darījumu nodrošinājumam tiek atkārtots attiecībā uz visiem VFD, kas iekļauti neto riska darījumu nodrošināšanā.
445. Ja abiem darījumu partneriem ir ziņošanas pienākums, tiem jānodrošina, ka paziņotajiem VFD tiek noteikts pāra statuss “Sapārots”, aizdevuma saskaņošanas statuss “Saskaņots” un nodrošinājuma saskaņošanas statuss “Saskaņots”.
446. Lai to atvieglotu, darījumu reģistrs nosūtīs viņiem šādu ziņojumu, kurā ietverta detalizēta informācija par saskaņošanas statusu katram VFD, par ko tie ir ziņojuši un kas ir jāsapāro.

115. tabula. Atgriezeniskā saite saskaņošanas gadījumā				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
1	Reporting counterparty	Unique key	Table A Field 3	<SctiesFincgRptgRcncltnStsAdv            <RcncltnData>            <Rpt>            <PaigrRcncltnSts>            <DtldNbOfRpts>2</DtldNbOfRpts>            <DtldSts>PARD</DtldSts>            </PaigrRcncltnSts>            <RcncltnRpt>            ...            <Txld>            <RptgCtrPty>            <LEI>1234567890123450000</LEI>            </RptgCtrPty>            <OthrCtrPty>            <LEI>ABCDEFGHIJKLMN            </LEI>            </OthrCtrPty>            <UnqTradldr>UT110</UnqTradldr>            </Txld>            <Modfd>>true</Modfd>            <RcncltnSts>            <RptgData>            <NotMtchd>            <CtrPty1>            <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA            </LEI>            </CtrPty1>            <CtrPty2>            <LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE            </LEI>            </CtrPty2>            <MtchgCrit>            <LnMtchgCrit>            <TermntnDt>            <Val1>2019-04-20            <Val2>2019-04-21            </TermntnDt>            </LnMtchgCrit>            <CollMtchgCrit>            <CmpntTp>            <Scty>
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 reconciliation	True/False	
	Matching status		True/False	
	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	
	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	
	Collateral reconciliation status		reconciled/not reconciled	

115. tabula. Atgriezeniskā saite saskaņošanas gadījumā				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
	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	<pre> &lt;Qty&gt; &lt;Val1&gt;1234&lt;/Val1&gt; &lt;Val2&gt;1243&lt;/Val2&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/CmpntTp&gt; &lt;/CollMtchgCrit&gt; &lt;/MtchgCrit&gt; &lt;/NotMtchd&gt; &lt;/RptgData&gt; &lt;/RcncltnSts&gt; &lt;/RcncltnRpt&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/RcncltnData&gt;  &lt;/SctiesFincgRptgRcncltnStsAdv&gt; </pre>

447. Pēc VFD izslēgšanas no saskaņošanas, šie VFD jāizslēdz arī no saskaņošanas ziņojumiem, kas tiek iesniegti darījumu partneriem un iestādēm. Darījumu reģistriem savās sistēmās jā saglabā šo VFD jaunākais saskaņošanas statuss.

## 8 Trūkst atgriezeniskās saites par nodrošinājumu

448. Jānorāda, vai VFD ir nodrošinājums, vai nav. Ja VFD ir nodrošināts, informācija par nodrošinājumu jāiesniedz, tiklīdz tā kļūst zināma.

449. Ja ziņošanas laikā informācija par nodrošinājumu vēl nav zināma, konkrētā informācija par nodrošinājumu, t. i., 2.75.–2.94. lauks, netiek ierakstīta. Tā vietā tiek aizpildīts 2.96. lauks vai nu ar derīgu nodrošinājuma groza ISIN numuru, vai ar "NTAV". VFD ziņojums tiks pieņemts.

450. Saskaņā ar RTS par datu vākšanu 3. panta c) punktu dienas beigās darījumu reģistrs sagatavo ziņojumu, kurā iekļauj to VFD "unikālos darījuma identifikatorus" (UDI), par kuriem Īstenošanas regulas (ES) 2019/363 I pielikuma 2. tabulas 72. laukā tiek ziņots kā par "nepareiziem" un par kuriem informācija par nodrošinājumu tās pašas tabulas 73.–96. laukā vēl nav paziņota. Tā kā informācija par atsevišķiem nodrošinājuma komponentiem ir iekļauta 2.75.–2.94. laukā, lai atgādinātu struktūrām, ka ir jāiesniedz konkrēta informācija par nodrošinājumu, darījumu reģistram jāizveido "Trūkstošā nodrošinājuma ziņojums", kurā iekļaujami UDI tiem VFD, par kuriem darījumu partneris ir ziņojis kā par nodrošinātiem un par kuriem tiek ziņots tikai 2.96. laukā.

451. Pamatojoties uz prognozi, ka konkrētās dienas VFD netiks piešķirts nodrošinājums, lai darījumu partneri nodrošinātu šo datu efektivitāti un izmantojamību, darījumu reģistram šajā ziņojumā jāiekļauj VFD, kas atbilst visiem turpmāk minētajiem nosacījumiem:

- a. VFD, par kuriem 2.72. laukā ir ierakstīts "nepareizs" un tiek paziņots tikai 2.96. lauks;

- b. VFD, kuriem izpildes laika spiedogā minētais datums atšķiras no termiņa datuma vai izbeigšanas datuma;
- c. VFD, kuriem jāveic saskaņošana.

## 9 Kā iesniegt informāciju iestādēm

### 9.1 Termiņi datu pieejamības iestatīšanai

- 452. Attiecībā uz datu pieejamības iestatīšanas termiņiem darījumu reģistram jāveido savi iekšējie procesi tā, lai saskaņā ar 4. panta 1. punkta f) apakšpunktu iestāde iegūtu tiešu un tūlītēju piekļuvi VFD informācijai trīsdesmit dienu laikā pēc pieprasījuma iesniegšanas par šādas piekļuves iestatīšanu.
- 453. Darījumu reģistriem jāizmanto informācija, kuru iestādes iesniedz uz attiecīgas veidlapas, kas iekļauta RTS par piekļuvi datiem. VFD dati par filiālēm un meitasuzņēmumiem iestādēm jāiesniedz, ņemot vērā arī esošos datus par LEI attiecībām.
- 454. Turklāt, nodrošinot piekļuvi datiem, ko darījumu partneri paziņojuši saskaņā ar VFDR 4. pantu, darījumu reģistram darbības un stāvokļa failos jāiekļauj tie VFD, par kuriem ziņots darījuma un pozīcijas līmenī.
- 455. Attiecībā uz RTS par piekļuvi datiem 4. panta 2. punkta k) apakšpunkta prasībām jānodrošina piekļuve precēm, ja ir iespējams identificēt to attiecīgās dalībvalstis.
- 456. Attiecībā uz RTS par piekļuvi datiem 4. panta 2. punkta n) apakšpunkta prasībām, ja piekļuve VFD jānodrošina centrālās bankas emitētā valūtā, šai piekļuvei datiem jāaptver visi ne-novērtējamie lauki, kuros attiecīgo valūtu izmanto. Ja vienu un to pašu valūtu emitē vairākas iestādes, kā tas ir eiro gadījumā, tām visām jābūt piekļuvei šiem VFD.
- 457. Attiecībā uz RTS par piekļuvi datiem 4. panta 2. punkta o) apakšpunkta prasībām, ja piekļuve jānodrošina VFD saistībā ar kritērijiem, kurus nosaka administrators, un VFDR 12. panta 2. punktā minētā struktūra ir attiecīgi pilnvarota, darījumu reģistram jānodrošina tādas informācijas saņemšana, kas attiecībā uz šiem kritērijiem apstiprina administratorus ar atbilstošām pilnvarām.

### 9.2 Darbības mehānismi attiecībā uz piekļuvi datiem

- 458. Attiecībā uz VFD informāciju, kas paziņota saskaņā ar RTS par ziņošanu pielikuma 1.–4. tabulu, tostarp norādot jaunākos darījuma stāvokļus tiem VFD, kuriem vēl nav beidzies termiņš vai par kuriem nav iesniegti ziņojumi ar darbības veidu “Kļūda”, “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana” vai “Pozīcijas komponents”, kā minēts ĪTS par ziņošanu I pielikuma 2. tabulas 98. laukā, darījumu reģistram jāizmanto šādas XML veidnes.

459. Attiecīgie darījumdarbības ziņojumi ir “auth.052.001.01” (darījumu partneris, aizdevums un nodrošinājums), “auth.070.001.01” (drošības rezerve) un “auth.071.001.01” (nodrošinājuma atkalizmantošana). Attiecīgie stāvokļa ziņojumi ir “079.001.01” (darījumu partneris, aizdevums un nodrošinājums), “auth.085.001.01” (drošības rezerve) un “auth.086.001.01” (nodrošinājuma atkalizmantošana). Šīs veidnes ir atjauninātas, lai varētu atjaunināt un precizēt veidnes, kas attiecas uz i) ziņošanu par repo darījuma nodrošinājumu un BSB nodrošinājumu, ii) ziņošanu par maržināla aizdevuma nodrošinājumu, iii) ziņošanu par neto riska darījuma nodrošinājumu un iv) aktīviem ar vairākiem nodrošinājumiem.
460. Turklāt tās pašas veidnes jāizmanto, kad darījumu reģistrs gatavo atbildes gan uz atkārtotiem vaicājumiem, gan uz ad hoc vaicājumiem par aizdevuma un nodrošinājuma datiem. Darījumu reģistram nav jānodrošina piekļuve drošības rezerves un atkalizmantošanas datiem, atbildot uz ad hoc vaicājumiem, jo nevienā no abiem ziņojumiem nav lauku, par kuriem varētu iesniegt vaicājumus.

116. tabula. VFD ziņojums — dati par darījumu partneri, aizdevumu un nodrošinājumu			
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> &lt;SctiesFincgRptgTxStatRpt&gt; &lt;Stat&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; &lt;RcncltnFlg&gt; ... &lt;/RcncltnFlg&gt; &lt;CtrctMod&gt; ... &lt;/CtrctMod&gt; ... &lt;/Stat&gt; ... &lt;/SctiesFincgRptgTxStatRpt&gt; </pre>

461. Turklāt datus par drošības rezervi un atkalizmantošanu datu beigu stāvokļa līmenī paziņo darījumu partneri, struktūras, kas atbildīgas par ziņošanu, vai ziņojumu iesniedzējstruktūras. Tas neliedz ziņojošajam darījumu partnerim, struktūrai, kas atbildīga par ziņošanu, vai ziņojuma iesniedzējstruktūrai paziņot šo informāciju vairākās daļās.



462. Darījumu reģistram darbības ziņojumā “auth.070.001.01” (drošības rezerve) jāiesniedz iestādēm visi VFD drošības rezervju ziņojumi, kas iesniegti attiecīgajā dienā, un stāvokļa ziņojumā “auth.085.001.01” jāraksturo jaunākais stāvoklis visās VFD drošības rezervēs, par kurām ir ziņots saistībā ar attiecīgā notikuma datumu, vai, ja par konkrēto datumu nav iesniegta informācija, jāiesniedz jaunākā paziņotā informācija.

117. tabula. VFD ziņojums — dati par drošības rezervi			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 3 Field 1 to Field 20	<pre> &lt;SctiesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt&gt; &lt;Stat&gt; ... &lt;CtrPty&gt; ... &lt;/CtrPty&gt; &lt;CollPrtfld&gt;...&lt;/CollPrtfld&gt; &lt;PstdMrgnOrColl&gt; ... &lt;/PstdMrgnOrColl&gt; &lt;RcvdMrgnOrColl&gt; ... &lt;/RcvdMrgnOrColl&gt; &lt;RcncltnFlg&gt; ... &lt;/RcncltnFlg&gt; &lt;CtrctMod&gt; ... &lt;/CtrctMod&gt; ... &lt;/Stat&gt; ... &lt;/SctiesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt&gt; </pre>

463. Nodrošinot piekļuvi atkalizmantošanas datiem attiecībā uz NFC, kas ir MVU, darījumu reģistriem jāiesniedz iestādēm visa informācija, kas paziņota ar darbības veidiem “NEWT” un “REUU” attiecībā uz ziņojošo darījumu partneri par konkrēto notikuma datumu. Lai noteiktu piemērojamos gadījumus, darījumu reģistriem jāizmanto lauki “Par ziņošanu atbildīgā struktūra” un “Ziņojuma iesniedzēja struktūra”. Ja kādam ziņojošajam darījumu partnerim ir vairāk nekā viena par ziņošanu atbildīgā struktūra un tie izmanto vienu un to pašu ziņojuma iesniedzēju struktūru, darījumu reģistram jāiesniedz visi nodrošinājuma atkalizmantošanas ziņojumi par šo notikuma datumu, kuri tika iesniegti attiecībā uz ziņojošo darījumu partneri.
464. Darījumu reģistram darbības ziņojumā “auth.071.001.01” jāiesniedz iestādēm visi VFD nodrošinājuma atkalizmantošanas ziņojumi, kas iesniegti attiecīgajā dienā, un stāvokļa ziņojumā “auth.086.001.01” jāraksturo jaunākais stāvoklis visos VFD nodrošinājuma atkalizmantošanas ziņojumos, kuri paziņoti saistībā ar attiecīgā notikuma datumu, vai, ja par konkrēto datumu nav iesniegta informācija, jāiesniedz jaunākā paziņotā informācija.

118. tabula. VFD ziņojums — dati par atkalizmantošanu			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 4 Field 1 to Field 18	<pre> &lt;SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt&gt; &lt;Stat&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; ... &lt;/CollCmpnt&gt; ... &lt;FndgSrc&gt; ... &lt;/FndgSrc&gt; &lt;RcncltnFlg&gt; ... &lt;/RcncltnFlg&gt; &lt;CtrctMod&gt; ... &lt;/CtrctMod&gt; ... &lt;/Stat&gt; ... &lt;/SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt&gt; </pre>

465. Attiecībā uz būtisko informāciju VFD ziņojumos, ko noraidījis darījumu reģistrs, tostarp visos VFD ziņojumos, kas noraidīti iepriekšējā darbadienā, un attiecībā uz to noraidīšanas iemesliem, kā norādīts RTS par datu pārbaudi I pielikuma 2. tabulā, darījumu reģistram jāizmanto tā pati XML veidne kā 113. tabula. Atgriezeniskā saite noraidījuma gadījumā.

119. tabula. Ziņojums par noraidījumiem				
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	
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	

119. tabula. Ziņojums par noraidījumiem				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
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. Attiecībā uz saskaņošanas statusu visiem paziņotajiem VFD, kuriem darījumu reģistrs ir veicis saskaņošanas procesu saskaņā ar RTS par datu pārbaudi (izņemot tos VFD, kuriem ir beidzies termiņš vai par kuriem VFD ziņojumi ar darbības veidiem “Kļūda”, “Izbeigšana/ pirmstermiņa izbeigšana” vai “Pozīcijas komponents” tika saņemti vairāk nekā mēnesi pirms datuma, kurā notiek saskaņošanas process), darījumu reģistram jāizmanto tā pati XML veidne kā 115. tabula. Atgriezeniskā saite saskaņošanas gadījumā.
467. XML shēmas definīcija (XSD) ir atjaunināta, lai abiem darījuma partneriem, par ziņošanu atbildīgajai struktūrai, ziņojuma iesniedzējai struktūrai un iestādēm varētu iesniegt saskaņošanas lielumus attiecībā uz vairākiem nodrošinājuma elementiem.
468. Nodrošinājuma saskaņošanas rezultāti jāpaziņo tikai vienreiz attiecībā uz visiem darījumiem, uz kuriem attiecas tas pats jumta līguma veids, un nodrošināšanas neto riska darījums ir PAREIZS.

120. tabula. VFD saskaņošanas statusa ziņojums				
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	
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		

120. tabula. VFD saskaņošanas statusa ziņojums				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
		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. Kad vaicājums ir saņemts, darījumu reģistram jāapstiprina, ka šis vaicājums ir pareizs un to var apstrādāt reģistra sistēmās. Nederīgu datu vaicājumu gadījumā (piemēram, kad vaicājums nav atbilstošs) darījumu reģistrs nosūta iestādei atsaukšanas ziņojumu, norādot, ka šis vaicājums ir nederīgs, un iekļaujot kļūdas veida aprakstu.

```

<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. Darījumu reģistri apstrādā ad hoc datu pieprasījumus iespējami ātrāk pēc to iesniegšanas un apstiprināšanas, arī brīvdienās. Termiņi, kuros jāsniedz atbildes uz ad hoc vaicājumiem, ir noteikti RTS par piekļuvi datiem 5. panta 4. punktā:

- a. ja tiek pieprasīta piekļuve informācijai par nenokārtotiem VFD vai par VFD, kuriem ir beidzies termiņš vai par kuriem ziņojumi ar darbības veidiem “Kļūda”, “Izbeigšana/ pirmtermiņa izbeigšana” vai “Pozīcijas komponents”, kā minēts ĪTS par ziņošanu I pielikuma 2. tabulas 98. laukā, tiek iesniegti ne vēlāk kā vienu gadu pirms pieprasījuma iesniegšanas dienas — ne vēlāk kā plkst. 12.00 pēc universālā koordinētā laika pirmajā kalendārajā dienā pēc dienas, kurā iesniegts piekļuves pieprasījums;
  - b. ja tiek pieprasīta piekļuve informācijai par VFD, kuriem ir beidzies termiņš vai par kuriem ziņojumi ar darbības veidiem “Kļūda”, “Izbeigšana/ pirmtermiņa izbeigšana” vai “Pozīcijas komponents”, kā minēts ĪTS par ziņošanu I pielikuma 2. tabulas 98. laukā, tiek iesniegti vairāk nekā vienu gadu pirms pieprasījuma iesniegšanas dienas — ne vēlāk kā trīs darbadienas pēc dienas, kurā iesniegts piekļuves pieprasījums;
  - c. ja tiek pieprasīta piekļuve informācijai par VFD, uz kuriem attiecas abi — a) un b) — apakšpunkti, ne vēlāk kā trīs darbadienas pēc dienas, kurā iesniegts piekļuves pieprasījums.
471. Ja datu vaicājuma iesniegšanas laiks ir īsāks par vienu dienu pirms pirmā izpildes datuma, pirmo izpildi var atlikt uz nākamo izpildes dienu atbilstoši vaicājumā norādītajiem parametriem.
472. Ja vaicājuma izpilde neizdodas tehnisku iemeslu dēļ, darījumu reģistrs nosūta kļūdas ziņojumu ESMA sistēmai. Kļūdas ziņojumā jāapraksta, kāda veida kļūda radusies.
473. Atbildot uz katru datu pieprasījumu, darījumu reģistrs sagatavo atbildes failu, kurā iekļauj datus par visiem vērtspapīru finansēšanas darījumiem, kas atbilst iestādes noteiktajiem meklēšanas kritērijiem:
- a) ad hoc vaicājumam tiek sagatavots vienreizējs atbildes fails (viens atbildes fails katram vaicājumam);
  - b) atkārtotam vaicājumam atbildes faili tiek gatavoti regulāri atbilstoši iestādes noteiktajam biežumam.
474. Darījumu reģistram jānodrošina iespēja VFDR 12. panta 2. punktā minētajām struktūrām noteikt datu piekļuves biežumu, kas atšķiras no vienas reizes dienā. Nosakot maksimālo izpildes ilgumu atkārtotam vaicājumam, darījumu reģistram jāņem vērā VFDR 12. panta 2. punktā minēto struktūru vajadzības un jāierobežo to sistēmu darbības riski.
475. RTS par piekļuvi datiem 5. pantā nav norādes par termiņiem, kas jāievēro darījumu reģistriem, veicot plānveida tehnisko apkopi, kas ietekmē darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem, neatkarīgi no izmantotā kanāla vai formāta.
476. Darījumu reģistriem rūpīgi jāplāno plānveida tehniskā apkope, kas ietekmē darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem, tā, lai šī apkope neiekristu darbadienās, kas noteiktas saskaņā ar kalendāru, kas tiek konsekventi saskaņots Savienības līmenī, piemēram, “Target2” kalendāru. Ja izņēmuma gadījumos tā iekrīt šādā darbadienā, plānveida tehniskā apkope jāveic ārpus parastā darba laika, t. i., ļoti agri no rīta vai ļoti vēlu vakarā. Darījumu reģistriem jāpārlicinās, ka iepriekš minētā plānveida apkope netiek īstenota tādā veidā, kas liedz iestādēm laikus saņemt informāciju par atvasinātajiem instrumentiem.

477. Darījumu reģistriem jāizmanto elektroniski līdzekļi, lai paziņotu visām iestādēm par plānveida tehniskās apkopes perioda sākuma un beigu datumiem un laiku.
478. Ja darījumu reģistrā notiek plānveida tehniskās apkopes periodu ikgadēja plānošana, ietekmējot darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem, darījumu reģistrs var paziņot visām iestādēm par šiem plāniem vienreiz gadā un vismaz trīs darbadienas iepriekš. Turklāt visi īpašie papildu paziņojumi par plānoto apkopi, kuri ietekmē darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem un kuri netiek nosūtīti vienreiz gadā, jāiesniedz pēc iespējas ātrāk un vismaz trīs darbadienas pirms sākās plānveida apkopes periods, kas ietekmē darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem.
479. Darījumu reģistriem jāreģistrē attiecīgie paziņojumi, kurus pēc pieprasījuma var darīt pieejamus ESMA. Plānveida tehniskās apkopes paziņojumu reģistrācijas ierakstos jāiekļauj vismaz šāda informācija — laika spiedogs paziņojumam par to, kad sāksies un kad beigsies plānveida tehniskās apkopes periods, kas ietekmē darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem, un attiecīgs informēto lietotāju saraksts.
480. Pārbaudot pieprasījumus saskaņā ar RTS par piekļuvi datiem 5. panta 5. punktu, darījumu reģistriem pēc iespējas ātrāk un ne vēlāk kā sešdesmit minūtes pēc attiecīgās plānveida tehniskās apkopes, kas ietekmē darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem, pabeigšanas jāapstiprina jebkura pieprasījuma par piekļuvi datiem saņemšana un jāpārbauda tā pareizība un pilnīgums.
481. Attiecībā uz piekļuvi datiem saskaņā ar RTS par piekļuvi datiem 5. panta 4. punkta a) apakšpunktu darījumu reģistram jācenšas pabeigt pieprasījumu pēc iespējas ātrāk un ne vēlāk kā plkst. 12.00 pēc universālā koordinētā laika pirmajā kalendārājā dienā pēc dienas, kurā tika pabeigta plānveida tehniskā apkope, kas ietekmē darījumu reģistra pakalpojumus saistībā ar iestāžu piekļuvi datiem. Termiņi, kas norādīti 5. panta 4. punkta b) un c) apakšpunktā, netiek mainīti.
482. Neplānotas tehniskās apkopes gadījumā darījumu reģistram jāievēro RTS par piekļuvi datiem 5. panta 4. un 5. punktā norādītie termiņi, un šie termiņi tiks izmantoti par pamatu, novērtējot darījumu reģistra atbilstību. Darījumu reģistram jāinformē ESMA par neplānotu tehnisko apkopi saskaņā ar šo reģistru procedūrām.
483. Izejas failus darījumu reģistri sagatavo ISO 20022 XML formātā. Izejas failos jāiekļauj tikai tie VFD dati, kas nepārsniedz iestādes likumīgās pilnvaras saskaņā ar RTS par piekļuvi datiem 1. un 2. pantu.
484. Izejas failos iekļauj tos darījuma datus, kas atbilst datu pieprasījumā noteiktajiem kritērijiem. Ja atbilde uz pieprasījumu satur lielu reģistrācijas ierakstu skaitu, atbildi sadala vairākos failos.
485. Izejas failā par katru darījumu jāiekļauj visi lauki, kas norādīti RTS un ĪTS un ko darījumu partneri paziņojuši darījumu reģistram. Datu vaicājuma kritērijiem jāierobežo tikai vaicājuma parametru (vaicājamo lauku) skaits un attiecīgi arī izejas failā iekļauto reģistrācijas ierakstu skaits, nevis tās informācijas apjoms, kas tiek piegādāta par katru darījumu (t. i., lauku skaits vienam darījumam).
486. Ja, izpildot vaicājumu, netiek parādīts neviens darījums, darījumu reģistram jānosūta attiecīgs atgriezeniskās saites ziņojums.

